



LDB
EMPRESAS

GUARULHOS
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 19.10.2020.

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

71,01%

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	6,00	-0,66	4,32	11.719.655,29	3,14	4.983.832.924,90	0,24
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,04	2,83	12.502.791,48	3,35	7.413.658.574,68	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,79	-1,53	-1,00	8.892.985,38	2,38	5.834.527.804,73	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,13	2,97	12.563.574,50	3,36	10.130.144.603,43	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	4,29	3.816.226,24	1,02	17.747.142.317,32	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,08	0,04	4,84	6.885.245,59	1,84	9.208.011.978,57	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,16	-0,81	5,51	19.981.211,90	5,35	717.075.038,12	2,79
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,10	-0,30	5,57	7.579.930,58	2,03	350.162.776,21	2,16
BB	BB	BB PREV RF VII	2,35	0,19	2,64	346.585,16	0,09	238.949.489,36	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,95	0,19	5,23	6.629.048,09	1,77	197.875.837,91	3,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	1,86	13.192.835,91	3,53	10.452.752.168,75	0,13
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	36.010.654,95	9,64	13.535.810.678,86	0,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,59	-2,09	6,52	16.032.159,31	4,29	1.656.081.726,62	0,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	27,49	-0,77	4,64	4.235.602,50	1,13	452.785.187,83	0,94
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	13,81	-1,92	1,01	7.146.890,98	1,91	354.253.837,74	2,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,88	-0,69	3,38	167.535.397,86	44,84		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	13,13	-1,71	-2,41	5.855.627,49	1,57	141.472.863,48	4,14
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			13,13	-1,71	-2,41	5.855.627,49	1,57		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	14,06	-1,63	-2,39	2.928.402,14	0,78	264.684.705,13	1,11
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,12	-0,11	1,19	5.078.327,88	1,36	495.909.483,11	1,02
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,94	-0,51	2,72	10.280.957,53	2,75	782.744.149,23	1,31
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,69	-2,18	0,10	28.486.915,51	7,62	591.294.917,81	4,82
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,02	1,82	4.645.628,23	1,24	2.533.726.732,47	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	-0,00	1,42	6.083.120,32	1,63	1.878.414.583,86	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,64	96.433,07	0,03	480.823.075,37	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	-0,23	2,47	11.781.132,97	3,15	4.773.930.449,92	0,25
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	5,61	-0,55	6,45	22.566.991,72	6,04	978.923.853,75	2,31
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,38	-0,87	1,30	91.947.909,37	24,61		
Renda Fixa			5,14	-0,78	2,35	265.338.934,72	71,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,74%

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
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	43,47	-2,74	-20,15	2.522.833,95	0,68	689.497.036,46	0,37
VINCI	BEM	VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	37,11	-5,04	-16,55	11.368.318,01	3,04	655.589.080,13	1,73
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	40,62	-4,50	-3,83	3.846.606,45	1,03	938.576.363,18	0,41
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	41,72	-6,15	-23,13	10.559.130,27	2,83	264.675.636,85	3,99
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,35	-4,58	-7,67	14.932.389,47	4,00	452.422.053,12	3,30
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	42,02	-2,81	-14,61	10.012.609,64	2,68	1.458.166.213,57	0,69
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	50,29	-5,95	25,51	12.033.408,15	3,22	476.018.609,99	2,53
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,85	-4,83	-16,08	65.275.295,94	17,47		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32,62	0,00	0,00	5.500.000,00	1,47	992.571.971,59	0,55
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	32,00	-4,80	25,74	16.535.576,22	4,43	545.147.723,89	3,03
Sub-total Artigo 8º III			17,61	-4,80	19,71	22.035.576,22	5,90		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	CEF	RBBV11	12,91	2,90	5,56	1.400.550,00	0,37	125.640.968,03	1,11
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			12,91	2,90	9,01	1.400.550,00	0,37		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

37,51

-4,71

-14,02

88.711.422,16

23,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,25%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,00	-0,89	-0,65	2.384.351,16	0,64	96.784.662,72	2,46
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,08	-1,63	-2,72	4.153.698,92	1,11	135.356.433,49	3,07
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA NO EXTERIOR	29,45	3,00	3,64	3.938.210,92	1,05	830.681.972,32	0,47
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,86	-1,36	-0,22	7.078.167,51	1,89	988.503.058,63	0,72
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR	11,58	-2,15	-2,15	2.054.846,77	0,55	102.230.549,01	2,01
Sub-total Artigo 9º A, II			13,07	-0,36	0,49	19.609.275,28	5,25		
Investimentos no Exterior			13,07	-0,36	0,49	19.609.275,28	5,25		
Total			9,26	-1,67	-0,19	373.659.632,16	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	167.535.397,86	44,84	20,00	50,00	90,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	5.855.627,49	1,57	0,00	0,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	91.947.909,37	24,61	5,00	20,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	265.338.934,72	71,01				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	65.275.295,94	17,47	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	22.035.576,22	5,90	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.400.550,00	0,37	0,00	1,00	3,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	88.711.422,16	23,74				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	19.609.275,28	5,25	0,00	3,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.609.275,28	5,25				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

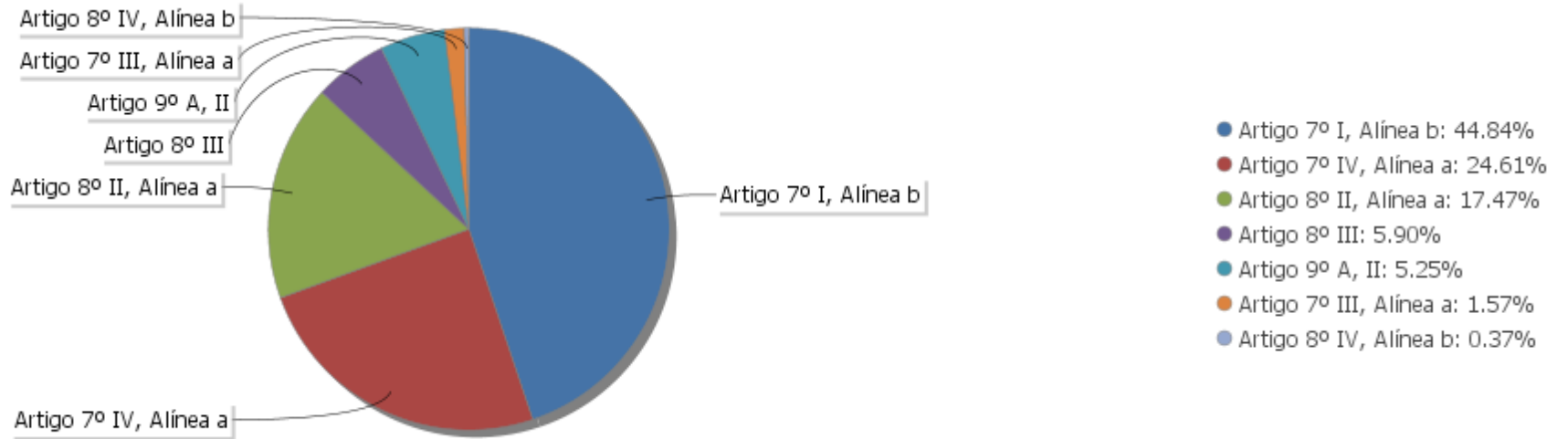
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,69 -440,69	3,38 148,47	0,31 61,34	3,81 304,37	5,50 155,20	-1.162.102,66	4.484.609,55
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,71 -1.090,39	-2,41 -1.287,44				-101.969,80	-144.372,51
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,87 -555,83	1,30 57,17	-0,16 -31,97	2,00 159,89	2,57 72,52	-890.878,43	1.592.403,74
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	-4,67 -205,44	0,00 0,00	1,25 99,77	-4,16 -117,36	0,00	-162.937,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,83 -0,04	-16,08 2,11	0,29 0,76	26,93 -2,63	-4,72 4,96	-3.315.243,44	-5.592.575,81
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,80 0,00	19,71 37,90	7,41 7,89	28,13 -1,43	20,84 30,52	-832.994,52	191.002,24
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,90 7,70	9,01 27,20	1,24 1,71	12,12 -17,44	10,09 19,77	39.536,13	116.766,77
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,36 -227,75	0,49 21,62	4,00 781,60	15,80 1.263,11		-76.509,43	120.011,28
						-6.340.162,15	604.907,52

Análise de Liquidez

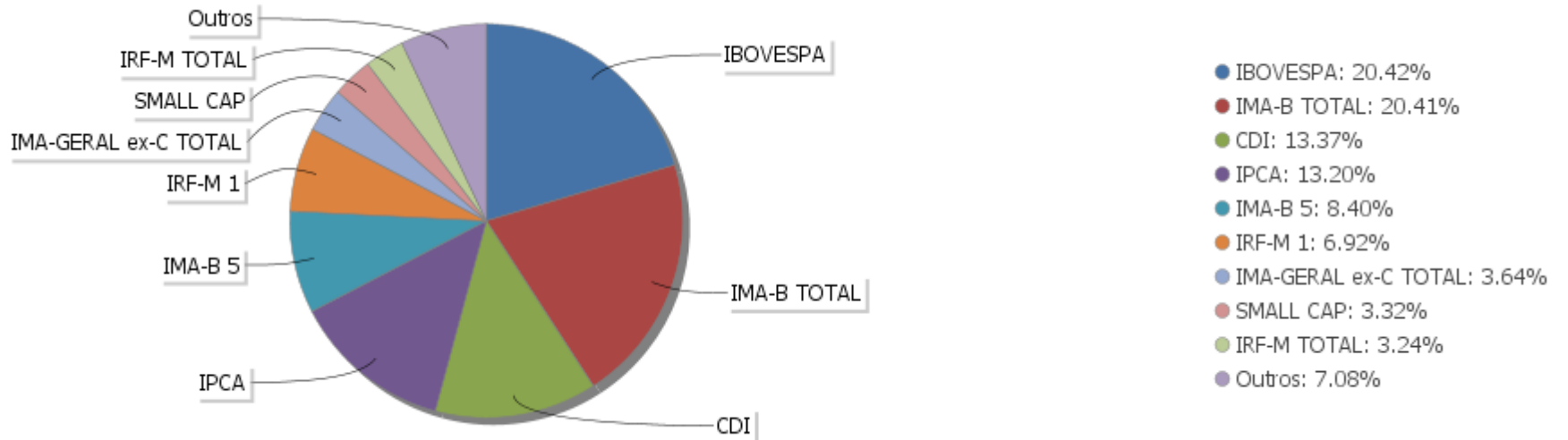
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	311.408.257,73	83,34	311.408.257,73	83,34
de 31 a 364 dias	36.313.317,12	9,72	347.721.574,85	93,06
acima de 365 dias	25.938.057,31	6,94	373.659.632,16	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

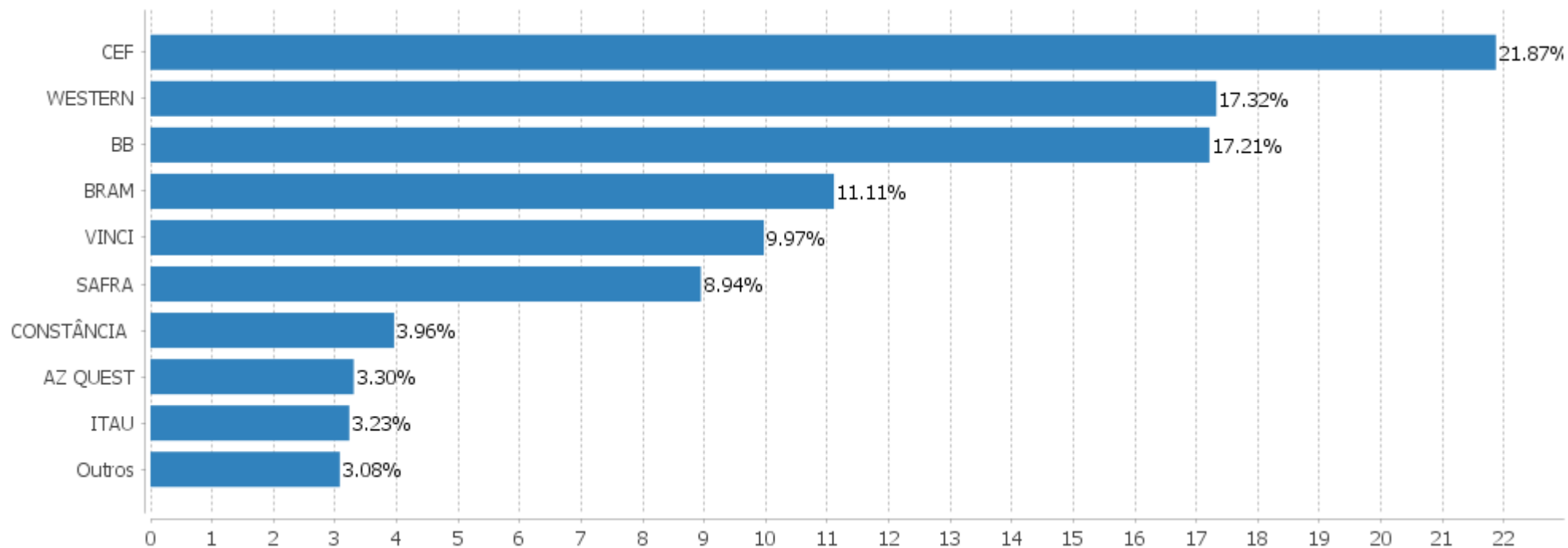


Alocação Por Estratégia



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	0,53	-0,88	-6,05	2,01	2,03	2,14	3,14	-1,11	-1,67				-0,19
INPC + 5,88%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,97	0,84	1,35				6,49
p.p. indexador	-0,16	-1,46	-6,73	1,78	1,83	1,36	2,17	-1,95	-3,02				-6,68
2019	2,07	0,41	0,50	0,79	1,47	1,74	0,86	0,16	1,41	1,46	-0,04	2,38	14,00
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	1,20	-0,59	-0,71	-0,30	0,81	1,29	0,23	-0,47	0,98	0,88	-1,05	0,67	3,22
2018	2,20	0,71	1,15	0,15	-1,66	0,02	1,59	-0,00	0,57	3,13	0,57	0,96	9,71
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	1,46	0,11	0,59	-0,55	-2,57	-1,91	0,83	-0,53	-0,17	2,21	0,36	0,36	0,12

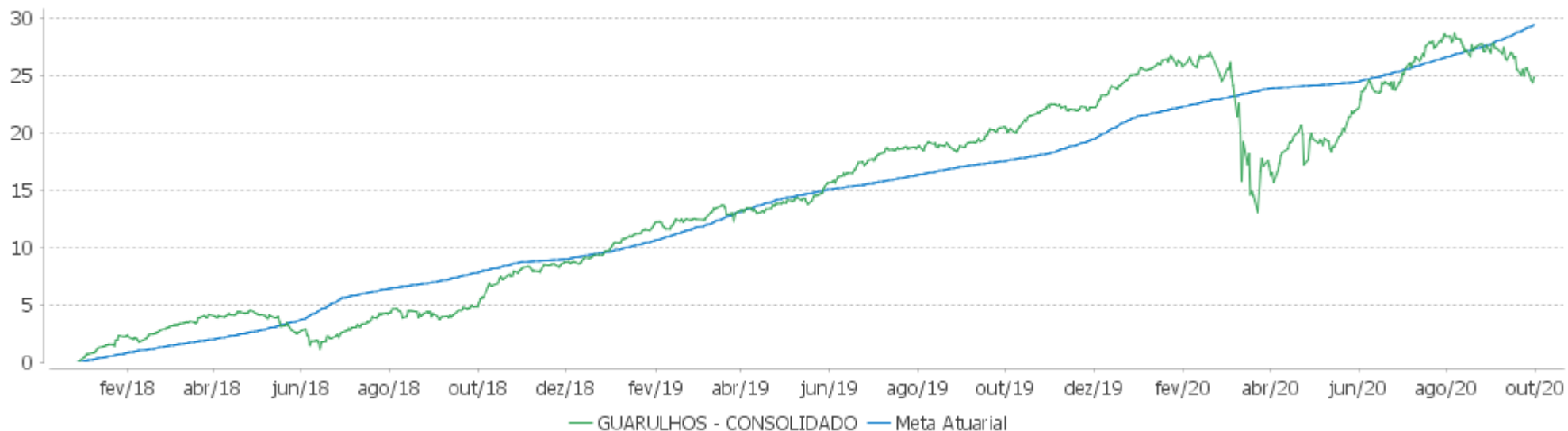
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

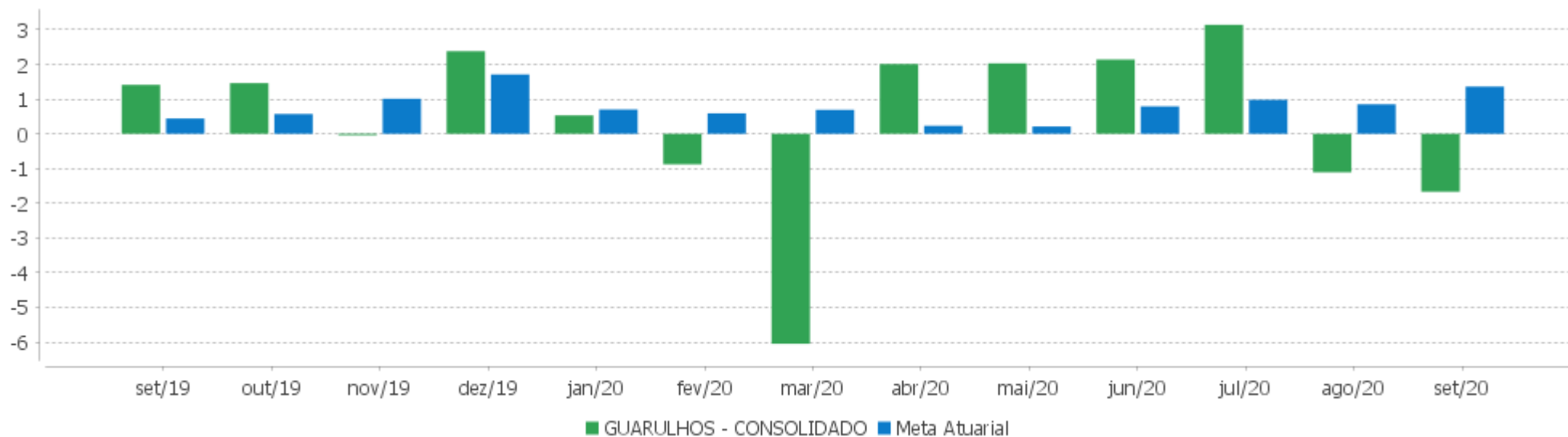
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	54,55	03 meses	0,29	3,19	-2,90	5,79
Meses abaixo da Meta Atuarial	15	45,45	06 meses	6,61	4,44	2,18	7,13
			12 meses	3,62	10,03	-6,40	9,26
			24 meses	19,14	20,01	-0,87	6,80
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,14	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,05	2020-03	Desde 29/12/2017	24,83	29,27	-4,45	6,00

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
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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,81 -0,69	5,51 1,00	0,67 -0,63	5,99 0,88	8,50 1,26	30,69 6,93	38,27 6,43
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,19 0,32	5,23 0,73	1,81 0,51	5,65 0,54	7,79 0,55	27,37 3,62	33,98 2,14
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 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
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	4,64 5,36	0,74 -0,22	5,94 -0,03	7,66 5,55	33,03 -1,11	36,92 -0,64
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,09 -0,58	0,03 0,74	0,54 -0,42	6,14 0,17	3,22 1,12		
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 1,70	2,64 3,36	0,98 0,02	3,41 -2,56	5,12 3,01	17,74 -16,40	26,32 -11,25
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,30 -1,43	5,57 -0,28	1,48 -1,30	6,07 2,28	8,40 -0,92	30,87 11,66	36,57 4,58
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	1,86 -0,10	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
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 TITULOS PUBLICOS 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
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,66 -0,10	4,32 -0,30	-0,35 -0,11	2,90 -0,25	6,21 -0,35	23,82 -0,67	30,66 -0,98
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
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,92 -0,40	1,01 1,73	0,22 -0,74	6,49 0,52	2,77 0,66	39,00 4,86	40,24 2,68
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,71 -0,20	-0,69 0,03	0,68 -0,28	5,74 -0,23	2,03 -0,08	34,81 0,67	36,35 -1,21
BRANCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	-0,11	1,80	0,20	0,86	3,00	9,17	16,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-71,14	79,28	38,52	69,15	84,57	91,32	92,97
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,18 -0,67	0,10 0,82	0,14 -0,82	6,57 0,60	3,16 1,05	41,32 7,18	43,49 5,93
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,55 -350,62	6,45 283,36	-0,05 -10,02	3,09 246,86	8,31 234,56	25,84 257,45	34,86 200,84
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,63 -0,11	-1,16 -0,44	0,82 -0,14	6,03 0,06	1,63 -0,48	34,80 0,66	36,81 -0,75
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
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA 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
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,51 0,08	2,72 0,32	0,72 0,19	3,82 0,39	4,70 0,35	22,49 0,64	28,74 0,32
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 55,34	1,64 71,97	0,29 57,43	0,83 66,45	2,68 75,66	8,21 81,83	14,47 83,39
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,50 0,29	-20,92 -2,73	-2,89 -2,41	20,12 -9,43	-6,28 3,40	46,96 27,72	47,91 20,57
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-2,74 2,06	-20,15 -1,95	5,81 6,28	32,85 3,29	-12,72 -3,04	15,23 -4,00	31,92 4,58
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,81 1,98	-14,61 3,59	0,84 1,31	29,98 0,42	1,22 10,91	57,42 38,18	48,33 21,00
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,58 0,22	-7,67 10,52	1,36 1,84	31,13 1,57	3,04 12,72	41,45 22,21	50,36 23,02
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	-5,95 -0,52	-17,96 0,97	3,71 1,44	32,67 -2,83			
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-5,04 -0,24	-16,55 1,65	-0,74 -0,26	18,30 -11,26	-5,72 3,96	41,91 22,68	32,20 4,86
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,15 -1,35	-23,13 -4,94	-4,25 -3,78	22,14 -7,42	-12,66 -2,97	14,79 -4,44	26,15 -1,19
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-4,88 -3.106,08	0,56 24,45	7,43 1.451,94	27,61 2.207,30	9,43 266,17	16,25 161,91	40,14 231,23
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME Var. IBOVESPA p.p.	-4,80 0,00	1,10 19,29	7,41 7,89	27,36 -2,20	9,96 19,64	16,39 -2,84	40,48 13,14
RBBV11	2,60	5,56	0,94	11,15	6,34	48,95	22,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IFIX p.p.	2,15	18,16	1,35	-0,90	2,21	18,03	-3,59
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,36	-0,22	3,27	14,98	6,40		
Var. INPC + 6% p.p.	-2,72	-6,80	0,05	10,48	-3,72		
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,63	69,46	14,16	48,30	82,99	83,28	
Var. IBOVESPA p.p.	3,17	87,65	14,63	18,74	92,67	64,04	
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-0,89	-4,77	2,17	6,12	-0,99	12,54	
% do CDI	-567,04	-209,70	424,55	489,65	-27,98	124,91	
WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR	-1,45	-1,01	2,98	14,33	5,24	19,20	13,94
% do CDI	-922,92	-44,42	581,04	1.146,13	147,79	191,25	80,32
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA NO EXTERIOR	3,00	86,27	22,64	64,22			
Var. IPCA + 6% p.p.	1,87	80,42	19,86	60,43			
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
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
439	01/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.521.730,24	0,00	1.669.277,40336600	2,1097333690
438	01/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.621.751,14	5.078.421,34461100	2,2884574460
433	01/09/2020	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	6.000.000,00	0,00	2.530.762,68582750	2,3708268000
440	02/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	777,24	0,00	368,39238800	2,1098155800
490	02/09/2020	WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR	2.100.000,00	0,00	1.320,20519420	1.590,6618222000
474	02/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.386,02	1.570,37930000	3,4297573000
441	03/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.210.971,31	0,00	5.313.571,62471100	2,1098748830
456	03/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	26.885,86	0,00	12.742,86935900	2,1098748830
451	03/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.564,44	6.902,98752700	2,1098748830
463	03/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	319.692,36	93.205,47070000	3,4299742000
443	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.643.402,07	1.252.826,37270900	2,1099508500
436	04/09/2020	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5.000.000,00	0,00	2.977.706,09314300	1,6791449000
448	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	105,43	0,00	49,96798800	2,1099508500
475	04/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	114,48	33,37410000	3,4301970000
444	08/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	169,99	80,56294300	2,1100271820
459	08/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.832,29	0,00	4.659,79305000	2,1100271820
465	08/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	320.871,00	93.536,97840000	3,4304187000
464	08/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	527.977,79	153.910,59980000	3,4304187000
476	08/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	11.714,60	3.414,91840000	3,4304187000
477	10/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.333,45	680,13900000	3,4308427000
466	10/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.012.300,23	586.532,34960000	3,4308427000
442	11/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.986,13	0,00	1.889,00447000	2,1101749950
445	14/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.820,84	28.348,71128100	2,1101784630
452	14/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.908,98	25.547,11885500	2,1101784630
457	14/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.428,85	10.154,99417500	2,1101784630
467	14/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	640.347,43	186.647,62670000	3,4307826000
478	14/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	12.941,68	3.772,22380000	3,4307826000
468	15/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	23.435,00	6.831,49910000	3,4304330000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
479	15/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	10.735,00	3.129,34250000	3,4304330000
469	16/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	108.950,73	31.768,80710000	3,4294876000
480	16/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	737,52	215,05250000	3,4294876000
453	17/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100.010,45	47.399,63735700	2,1099412480
461	17/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	100.001,00	0,00	29.163,18700000	3,4290148000
470	18/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	7.135,56	2.081,00100000	3,4289074000
481	18/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	3.744,95	1.092,17000000	3,4289074000
482	21/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.166,18	631,82240000	3,4284634000
483	22/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.330,00	679,60550000	3,4284594000
471	23/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	3.267,81	953,14450000	3,4284516000
485	23/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	59.374,79	17.318,25230000	3,4284516000
484	23/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	13.581,85	3.961,51240000	3,4284516000
472	24/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	22,49	6,56000000	3,4283396000
486	24/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	68,00	19,83460000	3,4283396000
449	25/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	183,44	0,00	86,93594500	2,1100592950
489	25/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	52.018,52	15.173,91310000	3,4281546000
488	25/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	7.763,70	2.264,69000000	3,4281546000
487	25/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	25.602,22	7.468,22400000	3,4281546000
454	28/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	150.000,00	71.094,35385800	2,1098721890
462	28/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	146.608,03	0,00	42.774,62010000	3,4274537000
473	28/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	75,81	22,11840000	3,4274537000
446	29/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.594.365,66	1.229.679,71338500	2,1097897540
455	29/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	117.157,10	55.530,22512200	2,1097897540
447	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.500.000,00	4.503.111,83656600	2,1096522460
437	30/09/2020	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	2.000.000,00	0,00	1.201.383,53730920	1,6647473000
434	30/09/2020	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2.000.000,00	0,00	852.082,26752040	2,3471912000
435	30/09/2020	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.500.000,00	0,00	1.571.134,18577170	3,5006558000
450	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	860.537,08	0,00	407.904,70639400	2,1096522460
458	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.470,12	1.644,87773100	2,1096522460
460	30/09/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	4.000.000,00	0,00	1.167.715,16290000	3,4254929000

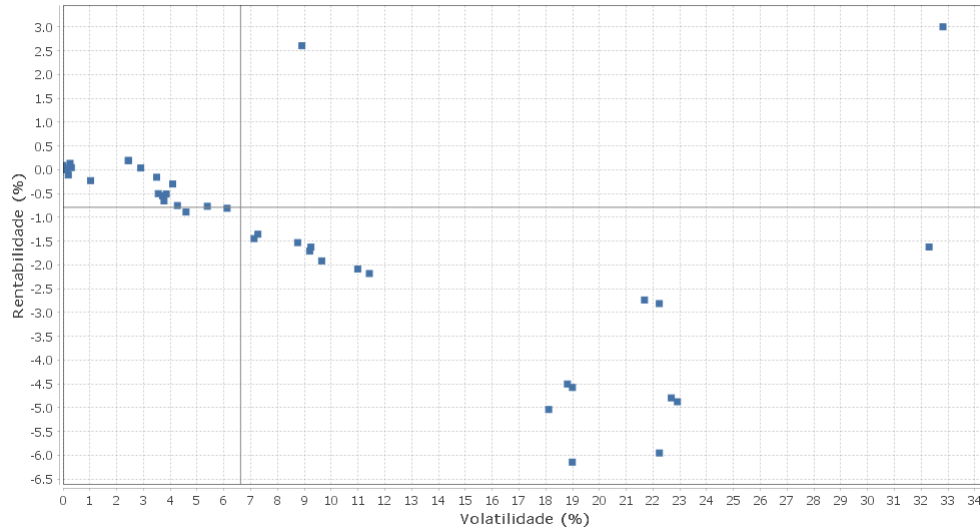
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
491	30/09/2020	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.500.000,00	0,00	2.884,94360330	866,5680664000

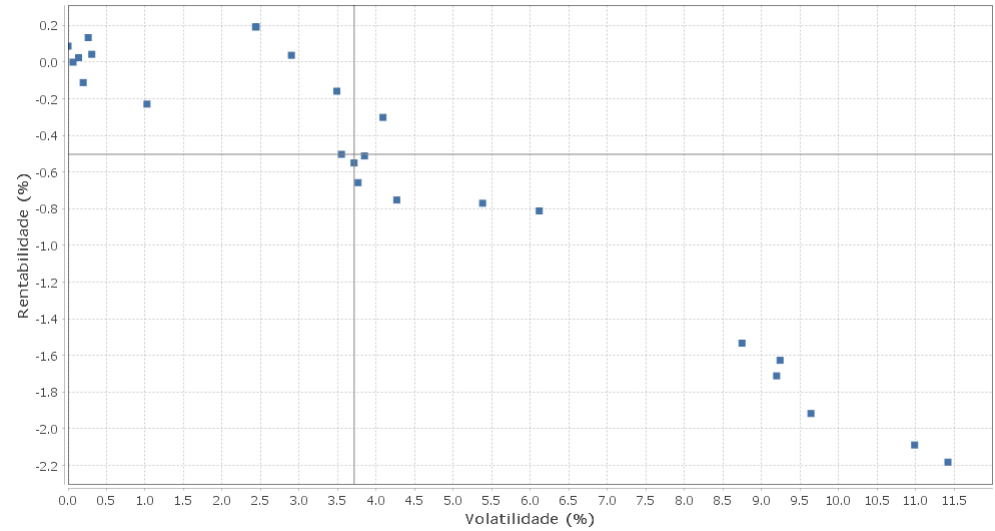
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

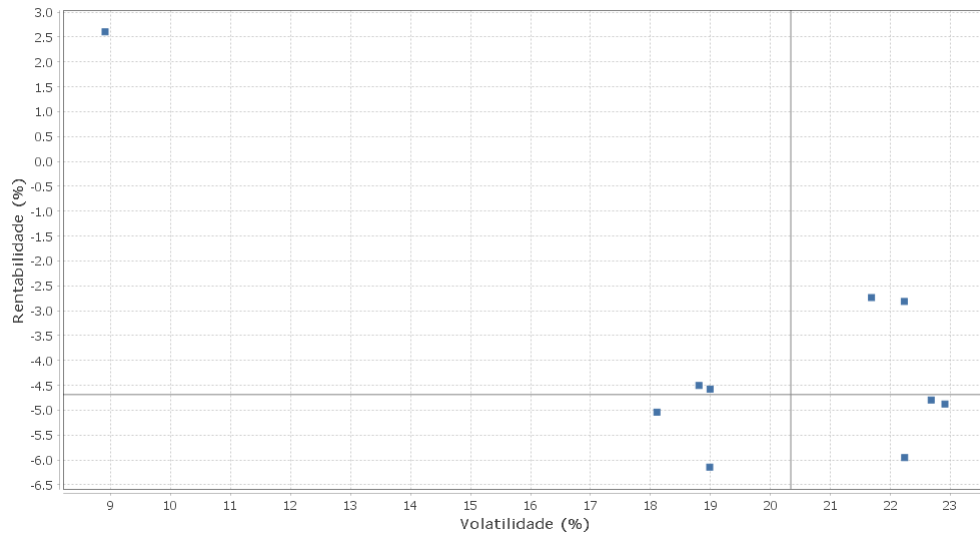
GUARULHOS - CONSOLIDADO - No Mês



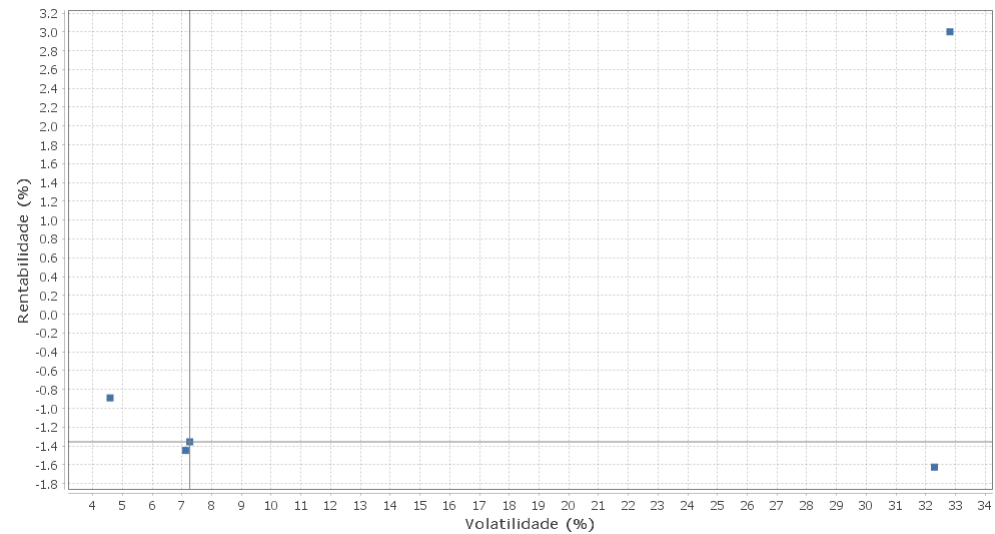
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-140,08	0,09	96.433,07	0,03
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	6.083.120,32	1,63
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,06	0,00	-0,97	0,02	4.645.628,23	1,24
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,20	0,08	0,00	-1,37	-0,11	5.078.327,88	1,36
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,14	0,00	-0,09	0,13	12.563.574,50	3,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,14	0,00	-0,37	0,04	12.502.791,48	3,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,02	0,41	0,01	-0,38	-0,23	11.781.132,97	3,15
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	0,55	0,00	0,01	0,19	346.585,16	0,09
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	0,98	0,01	0,01	0,19	6.629.048,09	1,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,03	0,01	-0,04	0,04	6.885.245,59	1,84
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,01	-0,09	-0,16	3.816.226,24	1,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,10	-0,19	-0,50	36.010.654,95	9,64
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,71	1,38	0,06	-0,19	-0,55	22.566.991,72	6,04
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,76	1,34	0,03	-0,22	-0,66	11.719.655,29	3,14
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,85	1,35	0,03	-0,17	-0,51	10.280.957,53	2,75
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	4,09	1,32	0,02	-0,11	-0,30	7.579.930,58	2,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,04	-0,21	-0,75	13.192.835,91	3,53
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	4,58	1,64	0,00	-0,23	-0,89	2.384.351,16	0,64
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	1,83	0,01	-0,17	-0,77	4.235.602,50	1,13
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,12	2,00	0,08	-0,16	-0,81	19.981.211,90	5,35
WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	7,12	2,60	0,00	-0,23	-1,45	2.054.846,77	0,55
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	7,26	2,61	0,02	-0,21	-1,36	7.078.167,51	1,89
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,75	3,24	0,06	-0,19	-1,53	8.892.985,38	2,38
RBBV11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,91	0,40	0,00	0,27	2,60	1.400.550,00	0,37
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	9,20	3,33	0,04	-0,20	-1,71	5.855.627,49	1,57
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	9,24	3,26	0,02	-0,19	-1,63	2.928.402,14	0,78
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	9,64	4,04	0,06	-0,22	-1,92	7.146.890,98	1,91
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,99	3,74	0,13	-0,20	-2,09	16.032.159,31	4,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,42	3,98	0,24	-0,20	-2,18	28.486.915,51	7,62
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	18,11	9,71	0,27	-0,29	-5,04	11.368.318,01	3,04
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	18,81	10,59	0,10	-0,25	-4,50	3.846.606,45	1,03
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,99	11,01	0,29	-0,33	-6,15	10.559.130,27	2,83
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,99	9,88	0,37	-0,25	-4,58	14.932.389,47	4,00
BRDESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	21,68	11,03	0,06	-0,13	-2,74	2.522.833,95	0,68
VINCI MOSAICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,23	12,71	0,31	-0,13	-2,81	10.012.609,64	2,68
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,24	11,98	0,32	-0,27	-5,95	12.033.408,15	3,22
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	Artigo 8º III	22,68	10,74	0,31	-0,22	-4,80	16.535.576,22	4,43
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	22,91	11,00	0,11	-0,22	-4,88	5.500.000,00	1,47
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	32,29	12,11	0,01	-0,06	-1,63	4.153.698,92	1,11
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	32,81	15,36	-0,04	0,09	3,00	3.938.210,92	1,05