



LDB
EMPRESAS

GUARULHOS
OUTUBRO 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 24.11.2020.

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

69,90%

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	6,05	-0,31	3,99	11.682.869,42	3,03	4.799.950.020,87	0,24
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,56	0,11	2,94	12.516.969,58	3,25	7.887.722.403,08	0,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,83	0,19	-0,81	8.910.195,57	2,31	5.818.645.931,87	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,14	3,11	12.581.527,43	3,27	11.237.812.745,76	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	0,18	4,48	3.823.142,76	0,99	18.309.382.329,52	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,15	5,00	6.895.764,66	1,79	9.550.097.040,26	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,22	-0,29	5,20	19.923.562,24	5,17	727.578.932,77	2,74
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,14	-0,37	5,18	7.552.122,46	1,96	348.878.151,21	2,16
BB	BB	BB PREV RF VII	2,40	0,49	3,15	348.292,11	0,09	240.126.324,03	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,96	0,49	5,75	6.661.805,47	1,73	198.853.639,86	3,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	1,78	13.183.569,62	3,42	9.938.464.189,22	0,13
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	35.971.831,34	9,34	13.635.004.724,81	0,26
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,68	-0,26	6,25	15.990.897,50	4,15	1.650.990.263,48	0,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,73	-0,18	4,45	4.227.822,50	1,10	451.953.430,56	0,94
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	13,86	0,15	1,16	7.157.512,94	1,86	354.780.248,04	2,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,90	-0,06	3,31	167.427.885,60	43,47		

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	13,18	0,04	-2,37	5.857.980,81	1,52	140.801.253,97	4,16
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			13,18	0,04	-2,37	5.857.980,81	1,52		

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	14,11	0,04	-2,35	2.929.561,78	0,76	255.142.702,45	1,15
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,33	0,04	1,23	6.923.115,45	1,80	392.885.921,38	1,76
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,97	0,08	2,81	10.289.202,16	2,67	766.439.026,51	1,34
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,78	-0,28	-0,17	28.408.154,07	7,38	587.567.612,49	4,83
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	1,98	4.653.032,44	1,21	2.401.972.433,04	0,19
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	1,48	8.429.766,70	2,19	1.611.170.285,08	0,52
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,73	96.516,87	0,03	622.243.810,38	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,08	2,55	11.790.275,37	3,06	4.590.560.763,79	0,26
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	5,71	-0,74	5,66	22.399.498,89	5,82	996.897.363,36	2,25
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,52	-0,23	1,07	95.919.123,73	24,91		
Renda Fixa			5,21	-0,12	2,23	269.204.990,14	69,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,28%

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	BRABESCO F I A SELECTION	43,96	3,33	-17,49	2.606.815,94	0,68	713.271.813,28	0,37
VINCI	BEM	VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	37,51	0,49	-16,14	11.423.914,41	2,97	668.172.814,54	1,71
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	40,98	-1,68	-5,45	3.781.874,34	0,98	1.029.368.645,48	0,37
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	42,11	-0,94	-23,85	10.460.225,16	2,72	253.207.728,61	4,13
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,65	-1,14	-8,72	14.762.674,28	3,83	455.411.757,37	3,24
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	42,43	-1,81	-16,15	9.831.849,67	2,55	1.386.037.200,22	0,71
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	48,30	-2,01	22,98	11.791.077,29	3,06	466.432.443,07	2,53
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,20	-0,95	-16,87	64.658.431,09	16,79		

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	32,99	-2,34	-2,34	5.371.183,18	1,39	991.427.993,44	0,54
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,37	-2,30	22,86	19.156.078,90	4,97	571.445.122,37	3,35
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	2,25	0,00	0,00	3.000.000,00	0,78	132.141.679,88	2,27
Sub-total Artigo 8º III			18,55	-2,31	16,95	27.527.262,08	7,15		

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	13,81	-4,16	4,48	1.337.700,00	0,35	126.230.937,11	1,06
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			13,81	-4,16	4,48	1.337.700,00	0,35		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

37,84

-1,33

-15,16

93.523.393,17

24,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,82%

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	7,99	-0,62	-1,27	2.369.631,20	0,62	97.626.389,63	2,43
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,43	-0,49	-3,20	4.133.492,82	1,07	140.713.941,41	2,94
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,79	-1,03	2,57	6.897.495,26	1,79	961.802.326,50	0,72
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,96	-1,27	-1,48	9.002.922,12	2,34	979.279.170,64	0,92
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR	11,69	-0,38	-2,53	0,00	0,00	100.026.998,60	0,00
Sub-total Artigo 9º A, II			12,82	-0,84	-0,35	22.403.541,40	5,82		
Investimentos no Exterior			12,82	-0,84	-0,35	22.403.541,40	5,82		
Total			9,43	-0,41	-0,61	385.131.924,71	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	167.427.885,60	43,47	20,00	50,00	90,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	5.857.980,81	1,52	0,00	0,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	95.919.123,73	24,91	5,00	20,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	269.204.990,14	69,90				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	64.658.431,09	16,79	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	27.527.262,08	7,15	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.337.700,00	0,35	0,00	1,00	3,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	93.523.393,17	24,28				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	22.403.541,40	5,82	0,00	3,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.403.541,40	5,82				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

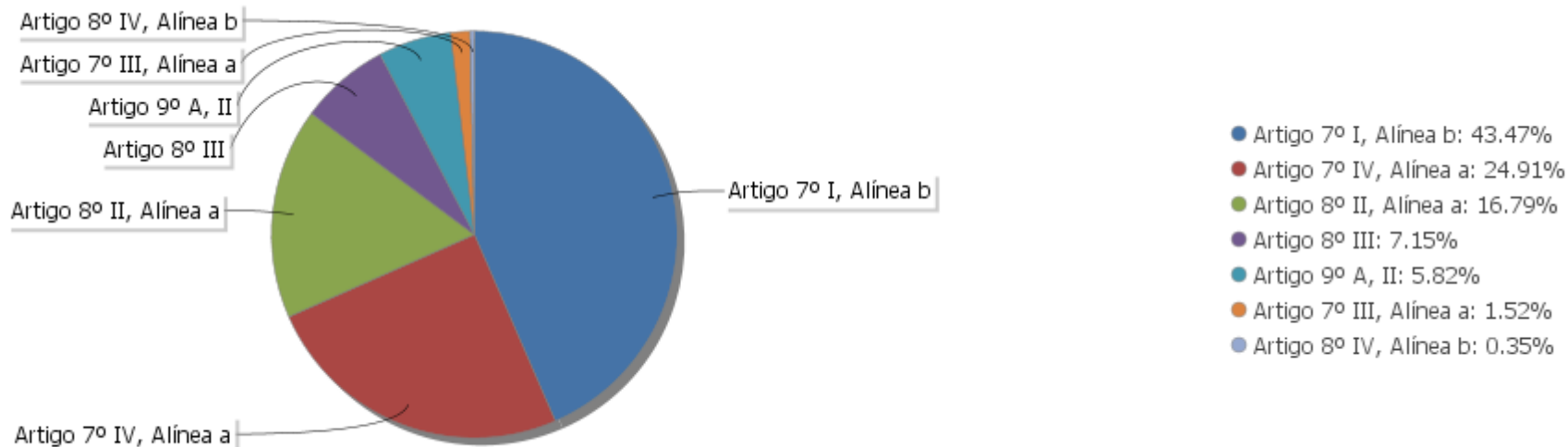
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,06 -40,88	3,31 135,96	-1,27 -267,80	2,84 253,12	3,68 114,50	-107.512,26	4.377.097,29
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,04 25,60	-2,37 -687,75				2.353,32	-142.019,19
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,23 -145,09	1,07 43,93	-1,89 -398,79	1,18 105,24	1,84 57,27	-224.550,87	1.367.852,87
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	-4,67 -191,90	0,00 0,00	0,75 66,91	-4,32 -134,50	0,00	-162.937,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,95 -0,26	-16,87 1,88	-9,39 -0,68	14,65 -2,05	-7,88 4,49	-616.864,85	-6.209.440,66
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-2,31 -1,62	16,95 35,71	-0,61 8,09	11,38 -5,32	17,47 29,85	-508.314,14	-317.311,90
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-4,16 -3,47	4,48 23,23	-2,18 6,53	0,43 -16,27	3,97 16,35	-58.002,72	58.764,05
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,84 -533,32	-0,35 -14,34	-1,08 -227,60	9,32 831,04		-205.733,88	-85.722,60
						-1.718.625,40	-1.113.717,88

Análise de Liquidez

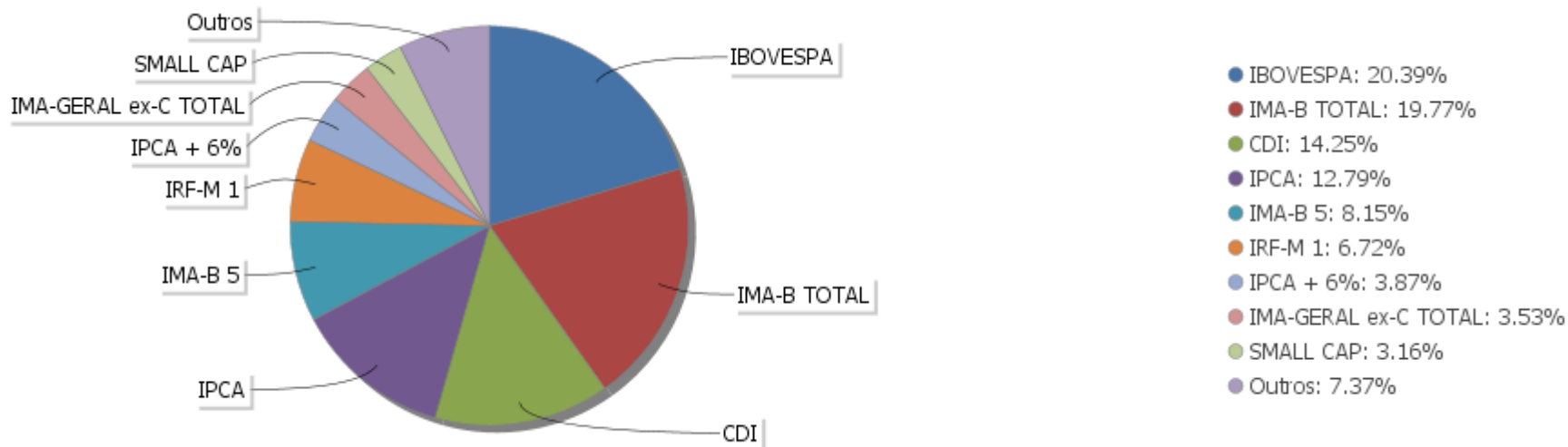
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	323.165.930,87	83,91	323.165.930,87	83,91
de 31 a 364 dias	36.018.438,36	9,35	359.184.369,23	93,26
acima de 365 dias	25.947.555,48	6,74	385.131.924,71	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

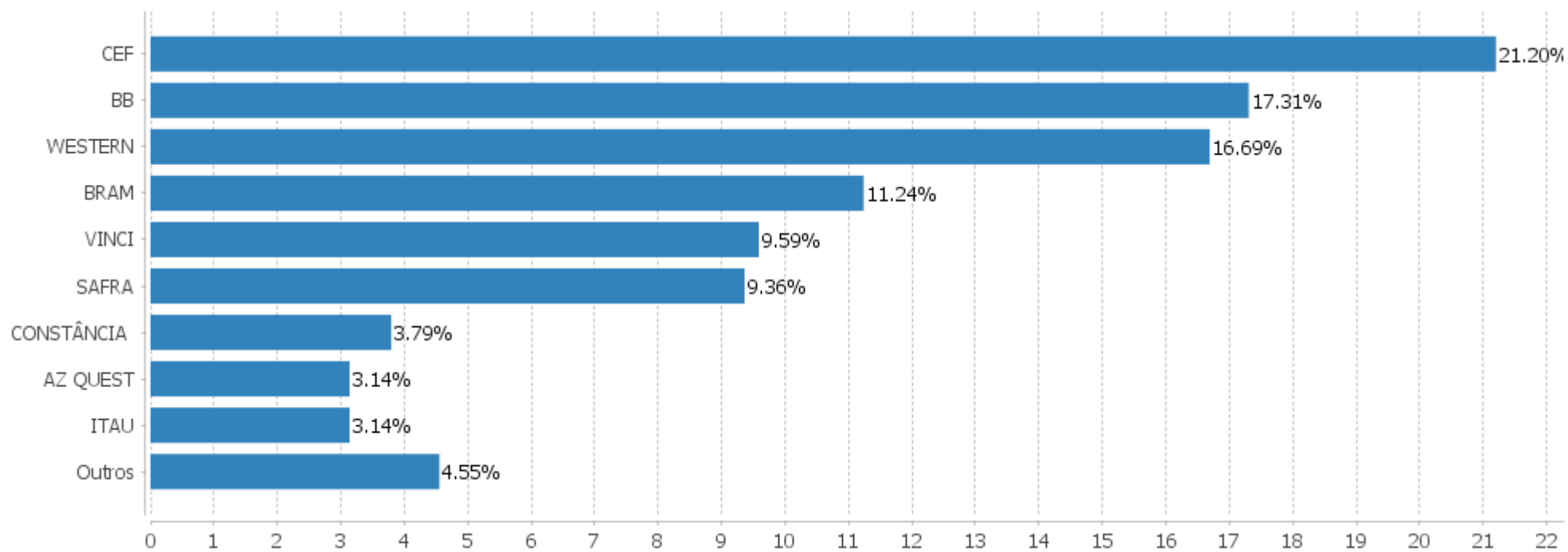


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

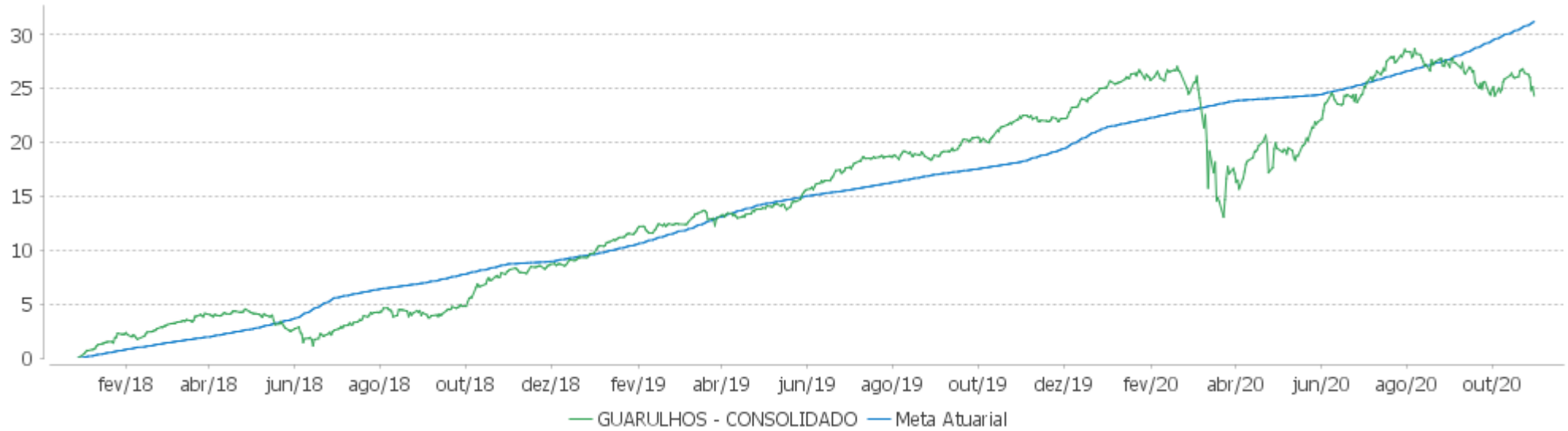
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,53	-0,88	-6,05	2,01	2,03	2,14	3,14	-1,11	-1,67	-0,41			-0,61
INPC + 5,88%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,97	0,84	1,35	1,37			7,95
p.p. indexador	-0,16	-1,46	-6,73	1,78	1,83	1,36	2,17	-1,95	-3,02	-1,78			-8,55
2019	2,07	0,41	0,50	0,79	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

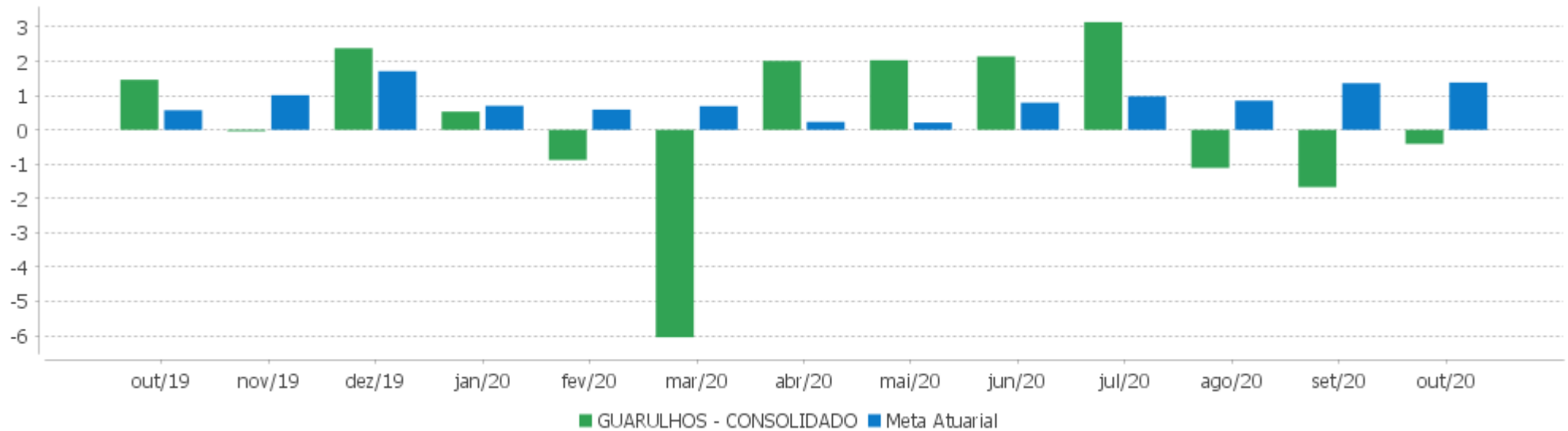
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	52,94	03 meses	-3,16	3,60	-6,77	6,18
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	47,06	06 meses	4,09	5,63	-1,55	5,90
			12 meses	1,71	10,90	-9,19	9,43
			24 meses	15,05	20,56	-5,51	6,87
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,14	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,05	2020-03	Desde 29/12/2017	24,31	31,05	-6,73	6,01

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.	0,19 -0,02	-0,81 -0,30	-3,15 -0,07	4,68 -0,13	-1,41 -0,40	24,69 -0,78	37,24 -1,15
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,29 -0,49	5,20 0,49	-1,39 -1,90	4,75 -0,06	5,61 -0,10	25,17 4,89	37,59 6,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,02	4,48 -0,24	0,41 -0,09	4,66 -0,15	5,38 -0,33	19,69 -0,58	30,54 -0,92
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,49 0,29	5,75 1,04	1,52 1,01	5,69 0,88	6,58 0,87	22,96 2,68	34,63 3,16
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,11 -0,05	2,94 -0,34	0,24 -0,19	1,13 -0,25	3,67 -0,39	10,79 -0,70	18,38 -0,98
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,40	4,45 4,95	-1,19 1,89	5,01 0,20	4,96 5,96	25,09 -0,37	36,82 -1,57
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,26 -0,47	-0,23 0,28	-4,32 -1,24	4,03 -0,78	-0,55 0,46	28,23 2,77	
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 0,28	3,15 3,66	1,16 4,23	3,77 -1,05	4,54 5,55	15,45 -10,01	26,10 -12,29
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,37 -1,72	5,18 -2,09	-0,01 -3,25	4,82 -0,21	5,91 -4,19	24,19 4,53	36,10 3,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07 -0,07	1,78 -0,17	-1,70 -0,31	2,07 -0,07	1,80 -0,37	17,32 0,22	27,46 0,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,11 -0,97	4,42 2,20	-1,16 -2,91	1,94 -0,06	4,51 0,59	23,65 17,10	32,48 21,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,15 0,12	5,00 -0,45	0,98 -0,11	4,98 0,13	6,16 -0,57	18,25 -1,35	29,01 -2,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,14 -0,02	3,11 -0,17	0,37 -0,06	1,27 -0,10	3,85 -0,21	11,05 -0,44	18,71 -0,65
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,31 0,01	3,99 -0,28	-1,76 -0,13	1,49 -0,15	4,12 -0,31	19,16 -0,62	30,15 -0,92
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,06	1,16 1,67	-3,69 -0,61	5,07 0,26	-0,42 0,59	27,59 2,12	41,34 2,95
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04 -0,17	-0,65 -0,15	-3,51 -0,44	4,41 -0,41	-1,41 -0,40	25,31 -0,15	37,35 -1,04
BRANCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	1,84	0,07	0,65	2,57	8,64	15,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	25,17	75,71	13,96	57,79	80,02	89,90	92,03
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,28 -0,49	-0,17 0,33	-5,01 -1,93	4,51 -0,31	-1,21 -0,20	30,17 4,70	43,94 5,56
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04 -0,17	-1,12 -0,61	-3,51 -0,43	4,57 -0,24	-1,85 -0,84	25,54 0,07	37,65 -0,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 101,53	1,98 81,34	0,36 76,91	1,12 100,00	2,69 83,84	8,87 92,26	15,98 95,19
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,74 -472,83	5,66 232,25	-1,67 -352,87	1,11 99,18	5,80 180,63	20,98 218,25	33,64 200,32
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 35,66	1,48 60,70	0,13 27,58	0,52 46,41	2,07 64,40	7,24 75,26	13,03 77,62
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,08 -0,01	2,81 0,31	-1,05 0,06	3,03 0,40	2,93 0,26	18,31 0,44	28,80 0,44
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,08 -0,78	2,55 0,33	-0,28 -2,03	1,25 -0,74	3,26 -0,66	17,36 10,81	25,35 13,94
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 55,36	1,73 70,85	0,26 55,74	0,70 62,32	2,36 73,40	7,80 81,13	13,92 82,88
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-2,34 -1.492,07	-1,80 -73,85	-0,68 -142,48	11,49 1.024,61	4,64 144,42	21,68 225,50	33,20 197,74
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO % do CDI	0,16 104,51	0,67 27,62	-0,39 -82,47	1,65 147,55	1,33 41,33	7,68 79,87	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-2,30 -1,61	-1,22 17,53	-0,60 8,11	11,39 -5,31	5,21 17,58	21,82 14,35	33,51 7,07
RBBV11 Var. IFIX p.p.	-4,16 -3,15	4,48 17,95	-2,18 -3,41	0,43 -5,83	3,97 4,88	45,43 22,05	21,69 -2,59
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,68 -0,99	-22,25 -3,49	-11,97 -3,26	8,45 -8,26	-9,43 2,95	24,35 16,88	45,41 18,98
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	3,33 4,02	-17,49 1,27	-0,65 8,06	28,48 11,78	-12,83 -0,46	6,67 -0,80	36,20 9,76
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,81 -1,12	-16,15 2,61	-9,18 -0,48	15,95 -0,75	-3,47 8,90	38,69 31,22	46,68 20,24
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,14 -0,45	-8,72 10,04	-8,04 0,66	16,81 0,11	-0,33 12,05	25,95 18,49	49,05 22,61
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	-2,01 0,27	-19,61 1,17	-10,74 -2,00	16,73 -3,43			
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	0,49	-16,14	-7,93	11,26	-7,62	29,71	33,23

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.	1,18	2,62	0,78	-5,44	4,75	22,24	6,79
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,94 -0,25	-23,85 -5,10	-12,39 -3,68	10,44 -6,26	-15,40 -3,03	2,66 -4,80	25,97 -0,46
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. INPC + 6% p.p.	-1,27 -2,65	-1,48 -9,53	-2,20 -5,84	8,08 2,39	1,68 -9,32	22,96 2,29	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	-0,49 0,20	68,63 87,39	11,52 20,23	24,97 8,27	81,38 93,75	119,27 111,80	
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-0,62 -393,29	-5,36 -220,01	-0,15 -31,75	3,46 308,24	-2,78 -86,71	14,48 150,55	
WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR % do CDI	-1,35 -861,62	-2,35 -96,45	-2,47 -520,05	7,48 667,22	0,59 18,34	20,29 211,06	13,23 78,79
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	-1,03 -2,38	84,34 77,07	17,49 14,25	37,99 32,96			
GUARULHOS - CONSOLIDADO Var. INPC + 6% p.p.	-0,41 -1,79	-0,61 -8,66	-3,16 -6,80	4,09 -1,61	1,71 -9,29	15,05 -5,62	
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
508	02/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	268.716,33	127.452,90768000	2,1083577840
497	02/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	777,24	0,00	368,64710800	2,1083577840
525	02/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	7.379,99	2.157,66410000	3,4203608000
513	05/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	26.938,13	0,00	12.783,38901700	2,1072760880
509	05/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.590,81	6.924,01441000	2,1072760880
498	05/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	339.066,02	0,00	160.902,51388000	2,1072760880
526	05/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.936,13	859,49890000	3,4160950000
520	05/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	327.371,79	95.832,16800000	3,4160950000
493	06/10/2020	WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR	0,00	2.046.936,64	1.320,20519538	1.550,4685538000
516	07/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.832,29	0,00	4.665,36199700	2,1075084860
502	07/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	159,54	75,70076300	2,1075084860
522	07/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	315.480,48	92.461,09410000	3,4120349000
527	07/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	6.903,50	2.023,27940000	3,4120349000
521	07/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	553.428,29	162.198,89650000	3,4120349000
528	08/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.023,50	1.472,13280000	3,4123958000
523	09/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.011.712,36	589.039,14880000	3,4152439000
499	13/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.051.783,93	0,00	972.105,33224900	2,1106600920
529	13/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	13.634,81	3.984,85760000	3,4216555000
514	14/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.418,40	10.146,86903600	2,1108383210
510	14/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.898,53	25.534,18206600	2,1108383210
503	14/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.106.747,03	998.061,76960200	2,1108383210
492	15/10/2020	WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.046.936,64	0,00	1.203,61224180	1.700,6612004000
530	15/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	648,64	189,35590000	3,4255061000
531	16/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.387,72	1.572,69440000	3,4257895000
532	20/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.926,15	1.729,79040000	3,4259408000
533	20/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	1.435,98	419,14910000	3,4259408000
518	22/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	584.019,38	0,00	170.461,63150000	3,4261046000
511	23/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	79.255,85	37.552,00111000	2,1105626240

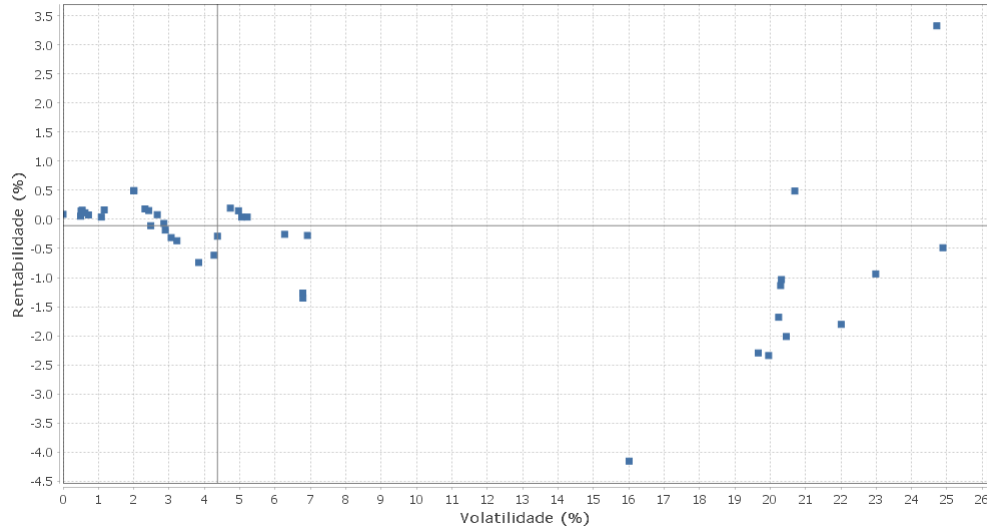
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
500	23/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.871.819,85	0,00	5.151.147,72069400	2,1105626240
534	23/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	783,03	228,55460000	3,4260075000
524	26/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	23,49	6,85600000	3,4261707000
535	26/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	436,76	127,47760000	3,4261707000
501	27/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	690,89	0,00	327,32837100	2,1106939090
512	28/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	124.771,44	59.110,84343700	2,1108045960
504	28/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	91.926,09	43.550,26049000	2,1108045960
536	28/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	396,88	115,82040000	3,4266848000
517	29/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55.000,00	26.056,30075900	2,1108138300
507	29/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	860.487,51	0,00	407.656,75199300	2,1108138300
515	29/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.470,12	1.643,97255300	2,1108138300
505	29/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.000.000,00	2.842.505,53730800	2,1108138300
519	29/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	4.600.000,00	0,00	1.342.361,51210000	3,4267967000
506	30/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.000.000,00	1.421.239,85719000	2,1108330060
496	30/10/2020	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	3.000.000,00	0,00	1.434.321,21250630	2,0915817000
495	30/10/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.000.000,00	0,00	15.806,51610349	189,7951440000
494	30/10/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3.000.000,00	0,00	14.095,33291900	212,8364060000
537	30/10/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	70.786,37	20.656,41690000	3,4268465000
Total						

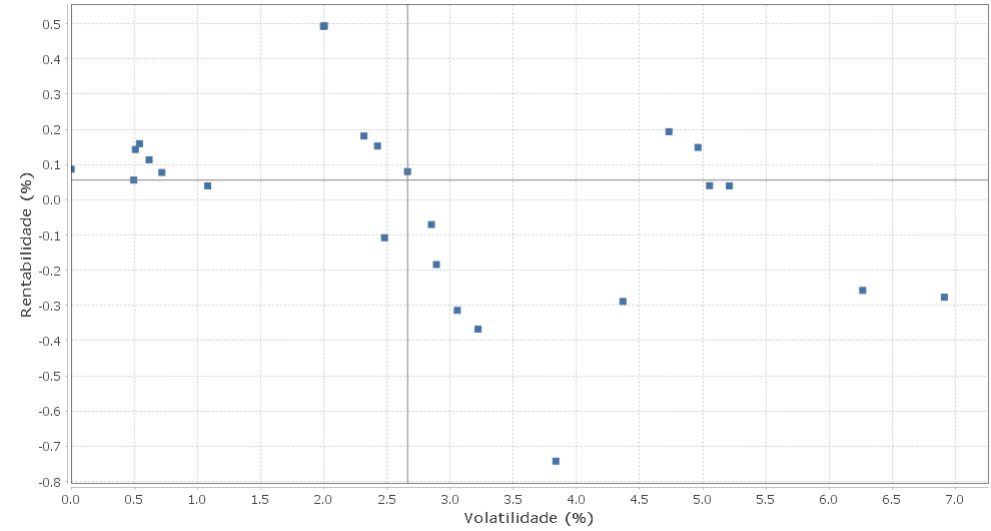
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

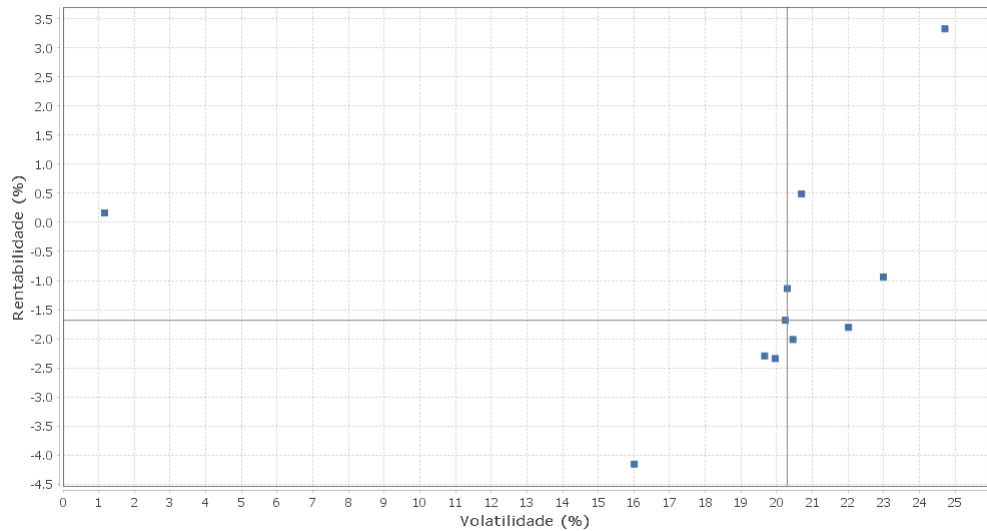
GUARULHOS - CONSOLIDADO - No Mês



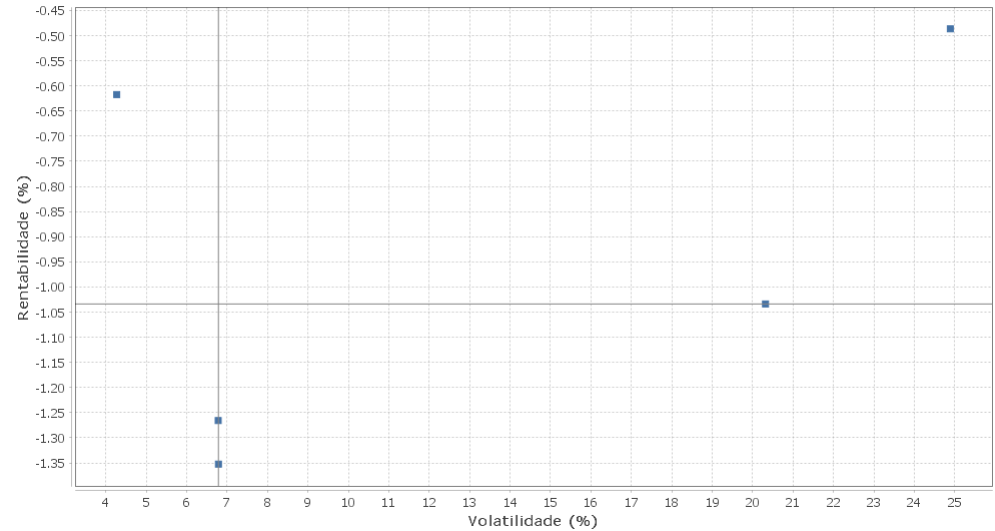
Renda Fixa - No Mês



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	-71,82	0,09	96.516,87	0,03
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,50	0,06	0,00	-0,20	0,06	8.429.766,70	2,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,51	0,16	0,00	-0,03	0,14	12.581.527,43	3,27
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,10	0,00	0,00	0,16	4.653.032,44	1,21
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,17	0,00	-0,07	0,11	12.516.969,58	3,25
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,72	0,33	0,01	-0,11	0,08	11.790.275,37	3,06
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	Artigo 7º IV, Alínea a	1,08	0,15	0,00	-0,11	0,04	6.923.115,45	1,80
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,16	0,65	0,00	0,01	0,16	3.000.000,00	0,78
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,00	0,89	0,00	0,17	0,49	348.292,11	0,09
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	0,94	0,01	0,17	0,49	6.661.805,47	1,73
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,02	0,01	0,01	0,18	3.823.142,76	0,99
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,08	0,01	-0,00	0,15	6.895.764,66	1,79
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,08	-0,11	-0,11	35.971.831,34	9,34
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,66	1,19	0,02	-0,03	0,08	10.289.202,16	2,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,03	-0,08	-0,07	13.183.569,62	3,42
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,89	1,80	0,01	-0,12	-0,18	4.227.822,50	1,10
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,06	1,36	0,03	-0,15	-0,31	11.682.869,42	3,03
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,42	0,02	-0,16	-0,37	7.552.122,46	1,96
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,84	1,43	0,06	-0,23	-0,74	22.399.498,89	5,82
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	4,27	1,78	0,00	-0,18	-0,62	2.369.631,20	0,62
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,37	1,87	0,07	-0,10	-0,29	19.923.562,24	5,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,73	3,16	0,05	0,01	0,19	8.910.195,57	2,31
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,96	2,95	0,04	-0,00	0,15	7.157.512,94	1,86
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,05	3,26	0,04	-0,02	0,04	5.857.980,81	1,52
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	5,21	3,38	0,02	-0,02	0,04	2.929.561,78	0,76
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	3,72	0,12	-0,07	-0,26	15.990.897,50	4,15
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	6,78	3,02	0,02	-0,21	-1,27	9.002.922,12	2,34
WESTERN ASSET MACRO STRATEGIES FIC FI MULT INVESTIMENTO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	6,79	NaN	0,00	-0,22	-1,35	0,00	0,00

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	6,91	3,77	0,21	-0,06	-0,28	28.408.154,07	7,38
RBBV11	Artigo 8º IV, Alínea b	16,01	0,09	0,00	-0,27	-4,16	1.337.700,00	0,35
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	19,66	10,23	0,33	-0,12	-2,30	19.156.078,90	4,97
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	19,96	10,49	0,10	-0,13	-2,34	5.371.183,18	1,39
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	20,24	9,11	0,08	-0,09	-1,68	3.781.874,34	0,98
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,30	9,44	0,34	-0,06	-1,14	14.762.674,28	3,83
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	20,32	13,01	-0,02	-0,06	-1,03	6.897.495,26	1,79
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,46	12,26	0,33	-0,11	-2,01	11.791.077,29	3,06
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	20,70	9,06	0,25	0,02	0,49	11.423.914,41	2,97
VINCI MOSAICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,01	12,00	0,28	-0,09	-1,81	9.831.849,67	2,55
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,99	9,96	0,25	-0,05	-0,94	10.460.225,16	2,72
BRDESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	24,72	10,79	0,07	0,13	3,33	2.606.815,94	0,68
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,89	11,85	0,04	-0,03	-0,49	4.133.492,82	1,07