



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
JUNHO 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 30.06.2020.

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

RENTA FIXA **85,64%**

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	11,95	1,92	-1,58	19.650.158,19	2,53	194.393.504,74	10,11
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,35	2,00	-1,78	27.453.730,62	3,54	362.047.246,48	7,58
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	109.316.502,69	14,08	7.792.694.548,07	1,40
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,14	2,08	-0,67	57.337.543,29	7,39	1.203.949.182,72	4,76
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	29.125.718,28	3,75	5.526.503.185,82	0,53
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,40	2,02	-1,84	30.395.177,89	3,92	753.868.354,78	4,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	59.164.045,21	7,62	5.979.262.081,07	0,99
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,23	2,32	19.005.943,67	2,45	133.747.358,36	14,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,26	2,48	43.687.841,02	5,63	11.257.382.974,77	0,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,53	0,26	2,44	1.017.876,79	0,13	980.825.577,34	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,36	0,89	1,61	15.564.425,44	2,01	1.297.957.904,60	1,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,44	1,24	0,08	411.718.963,09	53,04		

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
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,39	2,02	-1,86	31.673.022,38	4,08	2.894.677.261,07	1,09
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,39	2,02	-1,86	31.673.022,38	4,08		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,32	0,04	0,90	47.114.569,65	6,07	1.849.278.570,83	2,55
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,23	0,26	1,15	13.092.182,85	1,69	3.675.261.371,45	0,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	5,00	1,05	2,96	17.141.290,92	2,21	282.086.238,57	6,08
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,80	1,06	1,99	66.459.208,18	8,56	803.776.572,76	8,27
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	12,96	2,09	-1,70	31.640.217,75	4,08	1.949.868.392,71	1,62
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,40	2,03	-1,94	37.823.209,12	4,87	1.463.118.783,06	2,59
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,07	1,10	0,56	213.270.678,47	27,48		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	151,78	0,00	-83,89	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			151,78	0,00	-100,00	0,00	0,00		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,48	0,03	0,38	8.088.212,99	1,04	6.776.821.480,45	0,12
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,48	0,03	0,38	8.088.212,99	1,04		
Renda Fixa			7,12	1,22	0,15	664.750.876,93	85,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

14,36%

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
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	41,61	8,60	-18,80	18.092.266,85	2,33	325.482.350,79	5,56
BNY MELLON	BNY MELLON	ARX INCOME FIA	41,27	8,88	-12,28	24.003.831,67	3,09	681.181.627,14	3,52
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,57	7,89	-20,06	8.894.113,96	1,15	1.556.319.793,19	0,57
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	33,45	10,83	-13,80	13.151.480,65	1,69	161.432.583,08	8,15
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	35,67	8,92	-18,85	17.127.487,37	2,21	244.146.177,50	7,02
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	43,69	8,73	-18,09	4.557.073,51	0,59	48.731.409,44	9,35
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	40,84	8,97	-13,29	23.371.744,33	3,01	682.416.337,20	3,42
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			38,28	9,00	-15,77	109.197.998,34	14,07		

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	35,08	7,30	-15,79	2.247.750,00	0,29	0,00	
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			35,08	7,30	-15,79	2.247.750,00	0,29		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,88	8,97	-15,77	111.445.748,34	14,36		
Total			10,53	2,26	-2,56	776.196.625,27	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	411.718.963,09	53,04	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	31.673.022,38	4,08	0,00	5,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	213.270.678,47	27,48	0,00	23,85	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	0,00	0,00	0,00	0,05	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.088.212,99	1,04	0,00	1,10	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	664.750.876,93	85,64					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	109.197.998,34	14,07	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.247.750,00	0,29	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	111.445.748,34	14,36					30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,24 582,59	0,08 4,59	3,24 441,34	0,08 4,59	5,30 115,25	5.008.149,92	693.160,10
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,02 953,71	-1,86 -105,78	4,83 657,71	-1,86 -105,78	4,56 99,02	628.646,15	-598.909,04
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,10 519,01	0,56 32,06	2,94 399,80	0,56 32,06	5,20 112,91	2.326.392,21	1.081.600,00
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	-100,00 -5.700,03	0,00 0,00	-100,00 -5.700,03	-100,00 -2.172,46	0,00	-5.276,99
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,03 12,47	0,38 21,62	0,27 37,37	0,38 21,62	2,96 64,27	2.141,47	30.559,78
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,00 0,25	-15,77 2,03	27,05 -3,12	-15,77 2,03	0,96 6,81	9.017.598,66	-20.452.022,33
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	7,30 -1,45	-15,79 2,01	16,09 -14,09	-15,79 2,01	5,07 10,92	153.500,00	-427.850,00
CUBATÃO (Total)						17.136.428,41	-19.678.738,48

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	28.549.154,39	0,00	0,00	0,00	29.125.718,28	576.563,89	-518.257,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	105.655.532,66	8.365.200,00	-4.983.600,00	0,00	109.316.502,69	279.370,03	2.350.563,13
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.015.240,46	0,00	0,00	0,00	1.017.876,79	2.636,33	24.259,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	29.792.213,81	0,00	0,00	0,00	30.395.177,89	602.964,08	-569.607,04
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	19.279.143,22	0,00	0,00	0,00	19.650.158,19	371.014,97	-315.795,58
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.426.765,94	0,00	0,00	0,00	15.564.425,44	137.659,50	246.830,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	57.989.641,72	0,00	0,00	0,00	59.164.045,21	1.174.403,49	-1.130.934,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.574.889,17	0,00	0,00	0,00	43.687.841,02	112.951,85	1.058.967,73
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	26.915.101,79	0,00	0,00	0,00	27.453.730,62	538.628,83	-497.802,68
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	56.168.320,00	0,00	0,00	0,00	57.337.543,29	1.169.223,29	-388.255,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.960.036,73	7.973,28	-4.800,00	0,00	19.005.943,67	42.733,66	433.192,44
					411.718.963,09	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	31.044.376,23	0,00	0,00	0,00	31.673.022,38	628.646,15	-598.909,04
					31.673.022,38	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	37.070.180,57	0,00	0,00	0,00	37.823.209,12	753.028,55	-749.300,60
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.058.346,11	0,00	0,00	0,00	13.092.182,85	33.836,74	149.460,77
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	65.763.900,33	0,00	0,00	0,00	66.459.208,18	695.307,85	1.299.219,28
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	30.993.131,81	0,00	0,00	0,00	31.640.217,75	647.085,94	-546.922,04
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	16.962.625,59	0,00	0,00	0,00	17.141.290,92	178.665,33	492.515,00
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	47.290.301,85	0,00	-194.200,00	0,00	47.114.569,65	18.467,80	436.627,59
					213.270.678,47	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-5.276,99
					0,00	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	8.086.071,52	0,00	0,00	0,00	8.088.212,99	2.141,47	30.559,78
					8.088.212,99	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	15.724.724,51	0,00	0,00	0,00	17.127.487,37	1.402.762,86	-3.977.522,80
4UM SMALL CAPS FIA	11.866.435,87	0,00	0,00	0,00	13.151.480,65	1.285.044,78	-2.105.136,27
ARX INCOME FIA	22.046.922,87	0,00	0,00	0,00	24.003.831,67	1.956.908,80	-3.359.125,38
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	16.659.938,93	0,00	0,00	0,00	18.092.266,85	1.432.327,92	-4.189.194,04
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8.243.556,02	0,00	0,00	0,00	8.894.113,96	650.557,94	-2.231.479,66
ITAU INDEX IBOVESPA 1	4.191.105,07	0,00	0,00	0,00	4.557.073,51	365.968,44	-1.006.376,80
OCCAM FIC FIA	21.447.716,41	0,00	0,00	0,00	23.371.744,33	1.924.027,92	-3.583.187,38
					109.197.998,34	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	2.102.250,00	0,00	0,00	0,00	8.000,00	2.247.750,00	153.500,00	-427.850,00
						2.247.750,00	0,00	0,00

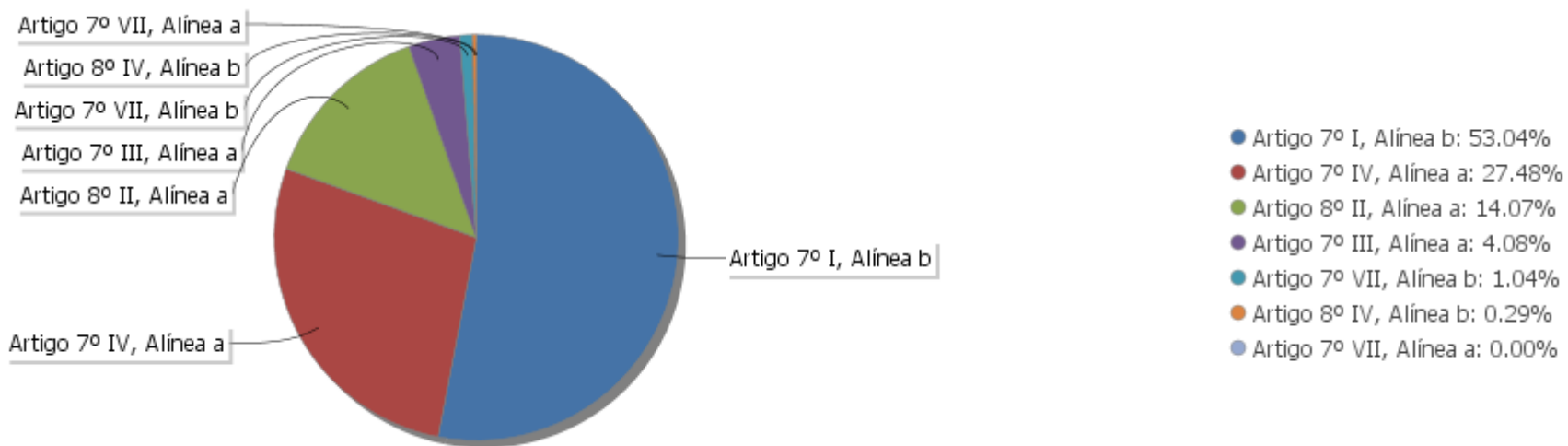
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

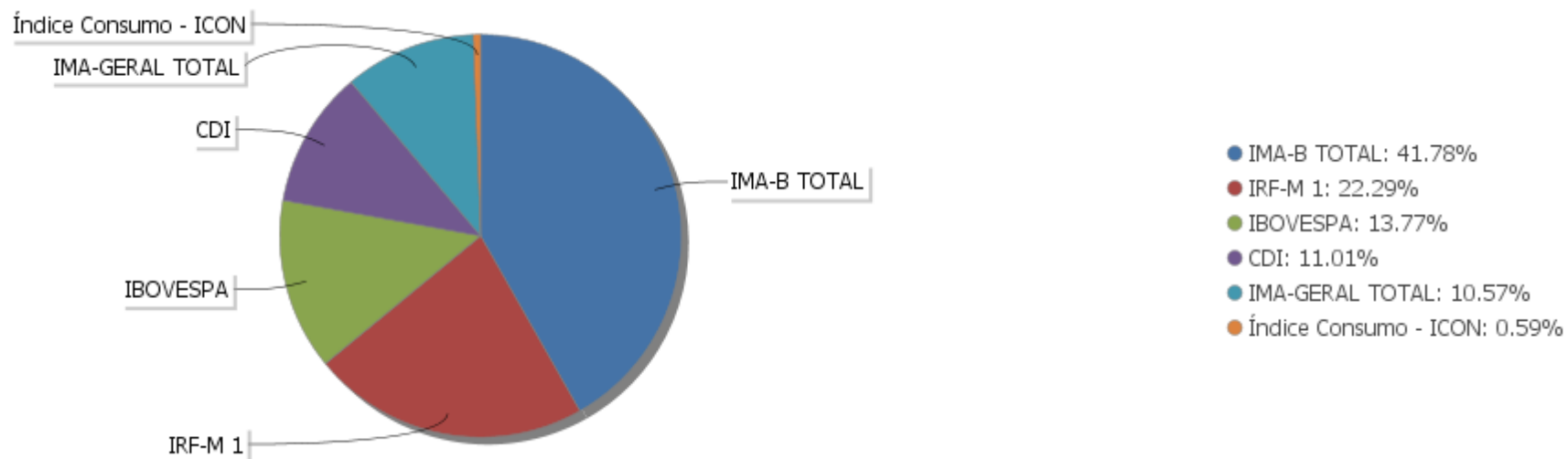
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	776.196.625,27	100,00	776.196.625,27	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	776.196.625,27	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	776.196.625,27	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

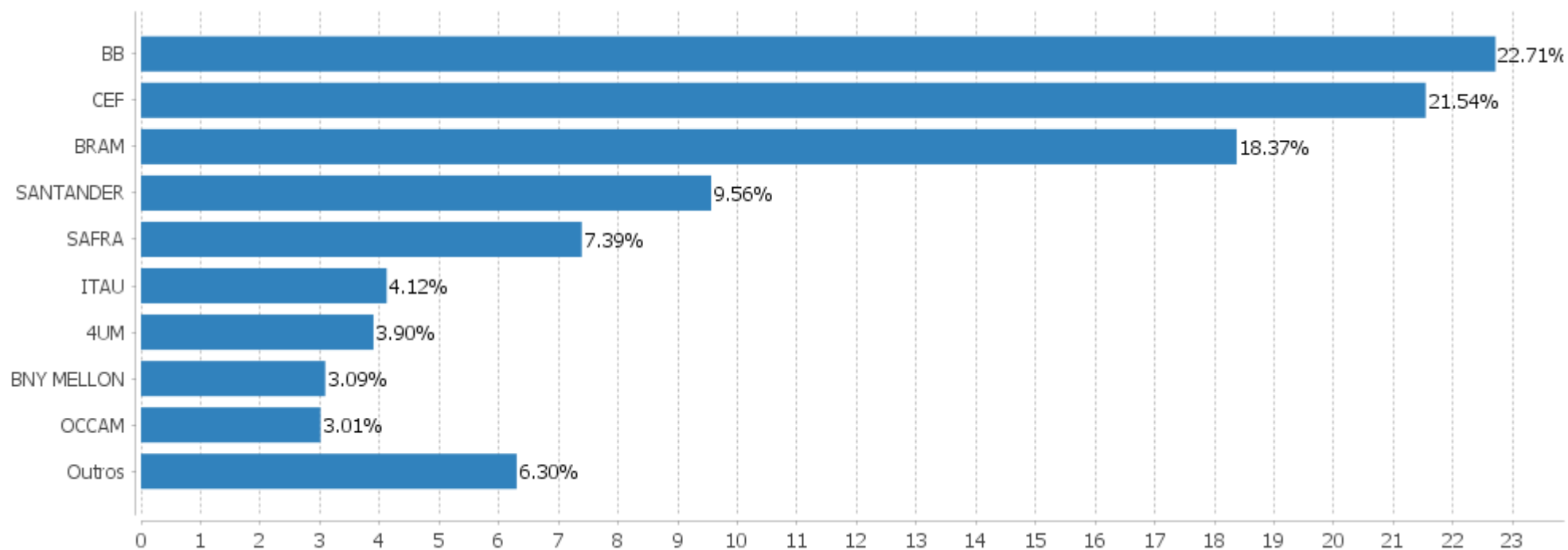


Alocação Por Estratégia



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	0,23	-0,94	-7,44	1,84	1,81	2,26							-2,56
INPC + 5,86%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78							3,19
p.p. indexador	-0,46	-1,52	-8,12	1,61	1,61	1,48							-5,75
2019	3,58	0,24	0,31	1,07	2,11	2,57	1,17	0,27	1,76	2,17	-0,86	2,58	18,27
INPC + 6,00%	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	2,70	-0,76	-0,90	-0,02	1,45	2,12	0,54	-0,36	1,33	1,60	-1,86	0,87	7,49

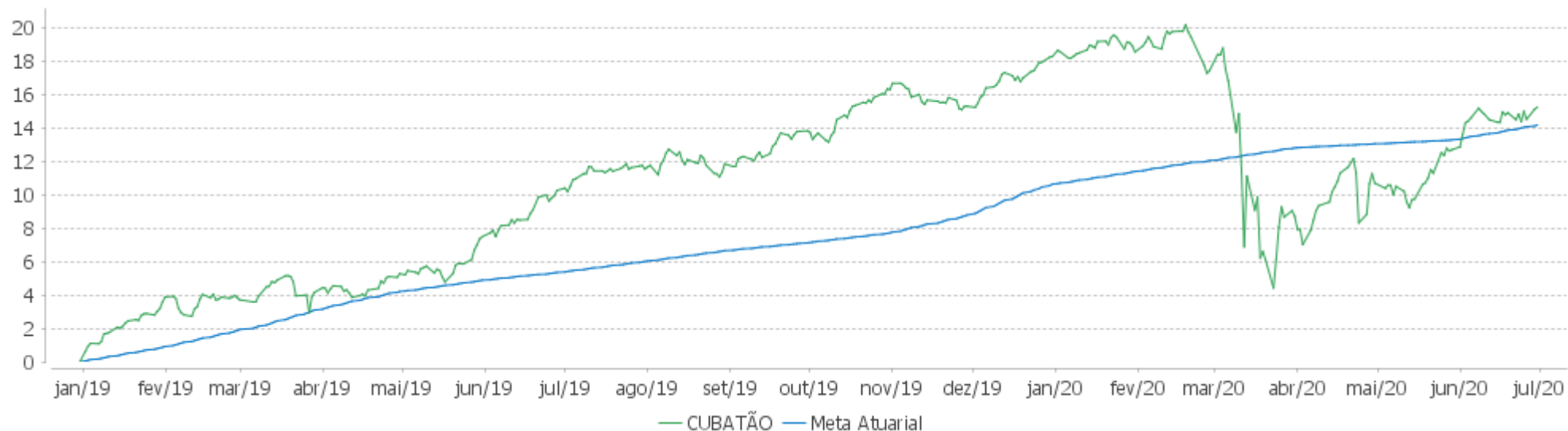
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

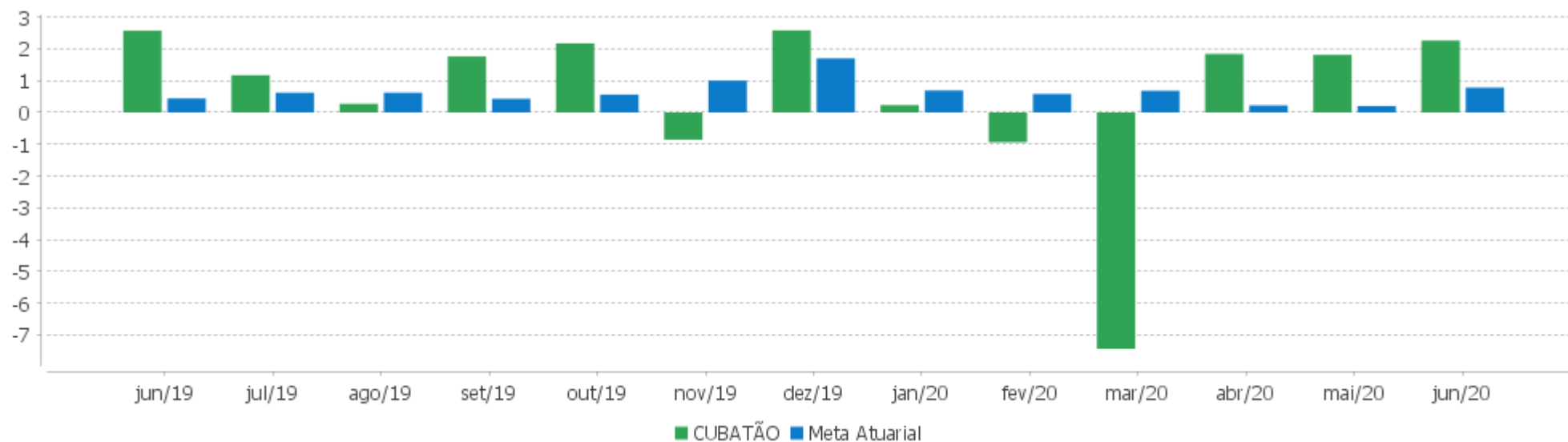
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	55,56	03 meses	6,02	1,20	4,82	9,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	44,44	06 meses	-2,56	3,19	-5,75	14,65
			12 meses	4,53	8,44	-3,91	10,53
			24 meses				
Desde 31/12/2018				15,24	14,31	0,93	8,99
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,58	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	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
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,02	-1,86 -0,19	4,83 -0,13	-1,86 -0,19	4,56 -0,39	34,21 -0,92	44,88 -1,33
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,03 12,47	0,38 21,62	0,27 37,37	0,38 21,62	2,96 64,27	9,43 84,12	17,58 90,66
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,00 -0,05	-1,78 -0,12	4,84 -0,12	-1,78 -0,12	4,69 -0,25	34,14 -0,99	44,48 -1,73
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	2,44 -0,16	1,07 -0,08	2,44 -0,16	5,70 -0,31	13,08 -0,59	21,64 -0,90
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,03	2,45 -0,14	1,06 -0,09	2,45 -0,14	5,71 -0,30	13,15 -0,52	21,70 -0,85
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,92 -0,12	-1,58 0,08	4,74 -0,22	-1,58 0,08	4,81 -0,14	34,49 -0,63	45,06 -1,14
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,03	-1,75 -0,08	4,90 -0,06	-1,75 -0,08	4,74 -0,20	34,48 -0,65	45,12 -1,09
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	2,48 -0,11	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,08 0,03	-0,67 0,99	5,49 0,53	-0,67 0,99	6,12 1,17	39,56 4,43	50,45 4,24
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,89 -0,09	1,61 -0,26	2,70 -0,19	1,61 -0,26	6,10 -0,42	22,48 -0,97	32,23 -1,67
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,02	-1,84 -0,18	4,86 -0,10	-1,84 -0,18	4,59 -0,36	34,19 -0,94	44,70 -1,50
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,23 -0,06	2,32 -0,27	1,00 -0,15	2,32 -0,27	5,47 -0,54	12,74 -0,93	20,98 -1,56
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	1,05 496,07	2,96 168,62	3,58 487,24	2,96 168,62	8,28 179,92	19,85 177,07	30,83 158,98
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,09 0,04	-1,70 -0,04	5,16 0,20	-1,70 -0,04	4,85 -0,10	35,14 0,01	45,86 -0,35
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,26 122,04	1,15 65,82	0,52 71,43	1,15 65,82	3,89 84,51	10,37 92,47	18,70 96,44
BB PREV RF IMA-B	2,03	-1,94	4,87	-1,94	4,50	34,26	45,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,28	-0,09	-0,28	-0,44	-0,87	-1,18
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	1,06	1,99	3,08	1,99	6,59	23,83	34,28
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,07	0,12	0,20	0,12	0,07	0,38	0,38
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,04	0,90	0,32	0,90	3,57	10,11	18,21
% do CDI	18,39	51,49	43,32	51,49	77,60	90,16	93,93
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	-83,89	0,00	-83,89	-95,23	-98,32	-99,28
% do CDI	0,00	-4.782,04	0,00	-4.782,04	-2.068,85	-876,86	-511,99
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	8,60	-18,80	28,15	-18,80	-8,80	24,60	26,89
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	-1,00	-2,03	-1,00	-2,95	-6,04	-24,23
4UM SMALL CAPS FIA	10,83	-13,80	21,75	-13,80	16,41	71,90	99,03
Var. IBOVESPA p.p.	2,07	4,01	-8,43	4,01	22,27	41,26	47,91
ITAU INDEX IBOVESPA 1	8,73	-18,09	29,98	-18,09	-6,45	13,50	14,60
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-1,35	-7,19	-9,47	-7,19	-20,44	-39,44	-40,62
OCCAM FIC FIA	8,97	-13,29	30,06	-13,29	3,73	44,34	75,17
Var. IBOVESPA p.p.	0,21	4,51	-0,12	4,51	9,58	13,70	24,04
ARX INCOME FIA	8,88	-12,28	32,41	-12,28	6,80	47,79	84,51
Var. IBOVESPA p.p.	0,12	5,53	2,23	5,53	12,66	17,15	33,39
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	7,89	-20,06	21,11	-20,06	-6,28	44,97	54,60
Var. IBOVESPA p.p.	-0,86	-2,25	-9,07	-2,25	-0,43	14,33	3,47
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	8,92	-18,85	21,67	-18,85	-3,01	25,94	57,00
Var. IBOVESPA p.p.	0,16	-1,04	-8,51	-1,04	2,84	-4,69	5,87
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	7,30	-15,79	16,09	-15,79	5,07	25,70	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,45	2,01	-14,09	2,01	10,92	-4,94	
CUBATÃO	2,26	-2,56	6,02	-2,56	4,53		
Var. INPC + 5,86% p.p.	1,48	-5,75	4,82	-5,75	-3,84		
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6,00%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6,00%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54	39,04	59,85
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60	72,00	102,38
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44	61,66	88,30
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90	53,21	79,16
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33	74,30	104,17
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21	65,68	93,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11	52,59	76,37
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90	52,95	77,21
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46	52,91	78,89
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45	90,04	122,98
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39	34,73	53,72

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12	84,48	79,08
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90	88,35	82,55
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47	79,25	71,91
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83	126,79	122,31
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30	71,31	92,15
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22	70,53	65,20
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57	119,48	110,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21	13,51	23,55
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47	12,27	22,93
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21	21,26	36,06
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,22	19,40	34,77	53,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,77	30,37	26,35	30,37	50,59	61,97	111,76	152,00	165,23
MSCI ACWI	3,97	26,16	24,99	26,16	43,29	47,56	86,82	124,27	118,76
MSCI World	3,45	26,83	25,18	26,83	44,43	49,67	90,18	127,21	123,90

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	2,03	0,52	2,03	6,23	14,15	23,87	32,67	50,18
IPCA + 5,00%	0,67	2,51	0,75	2,51	7,26	16,35	27,45	37,81	57,50
IPCA + 5,50%	0,71	2,75	0,87	2,75	7,77	17,45	29,27	40,44	61,27
IPCA + 5,89%	0,74	2,93	0,96	2,93	8,17	18,32	30,70	42,52	64,26
IPCA + 6,00%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11	43,11	65,11
INPC + 4,00%	0,63	2,30	0,77	2,30	6,46	14,33	23,04	31,22	49,42
INPC + 6,00%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23	41,54	64,27

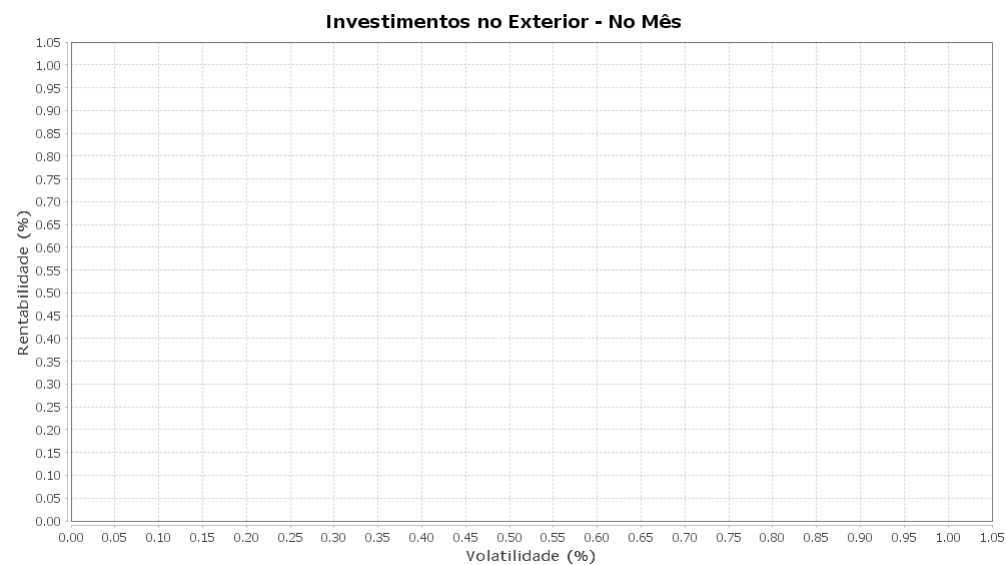
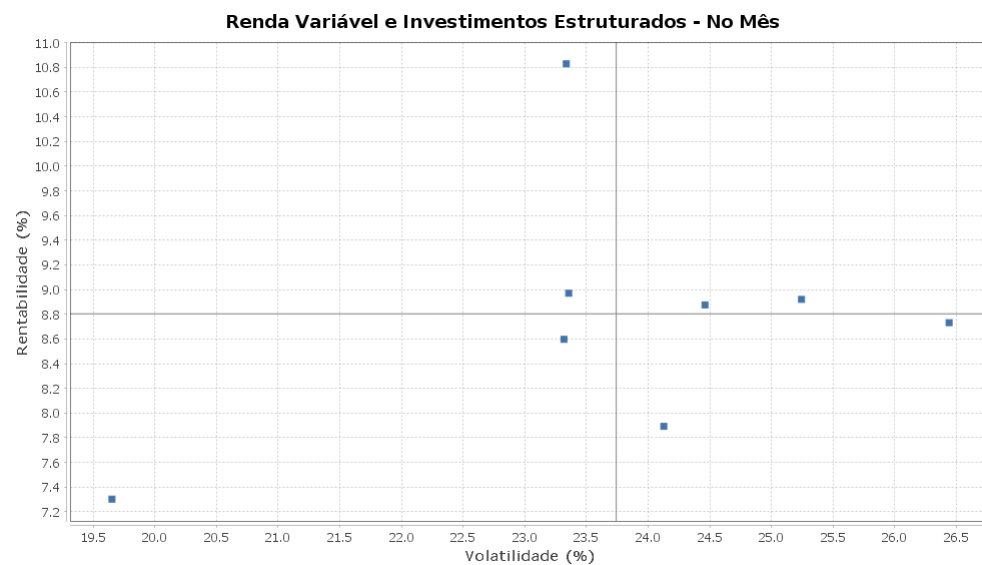
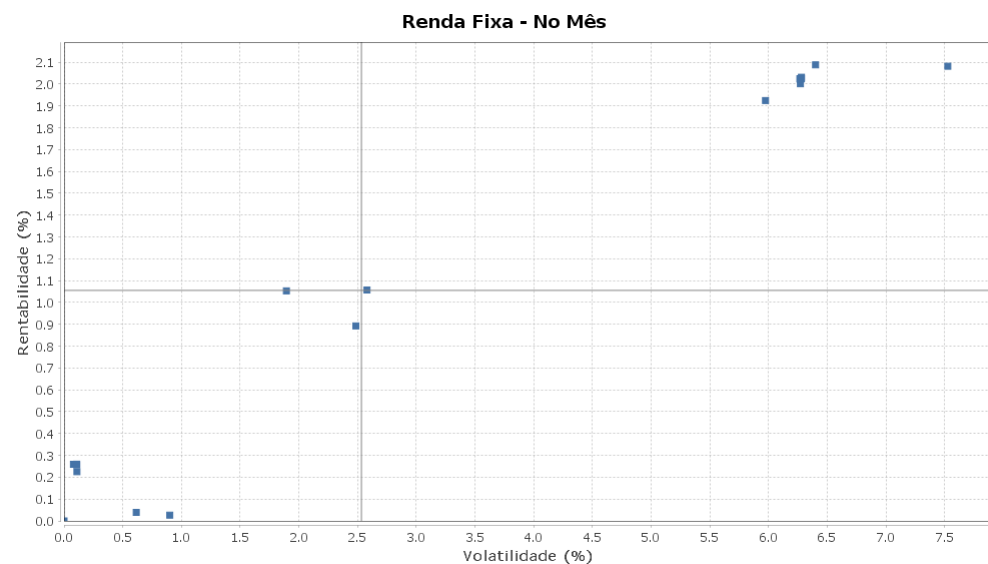
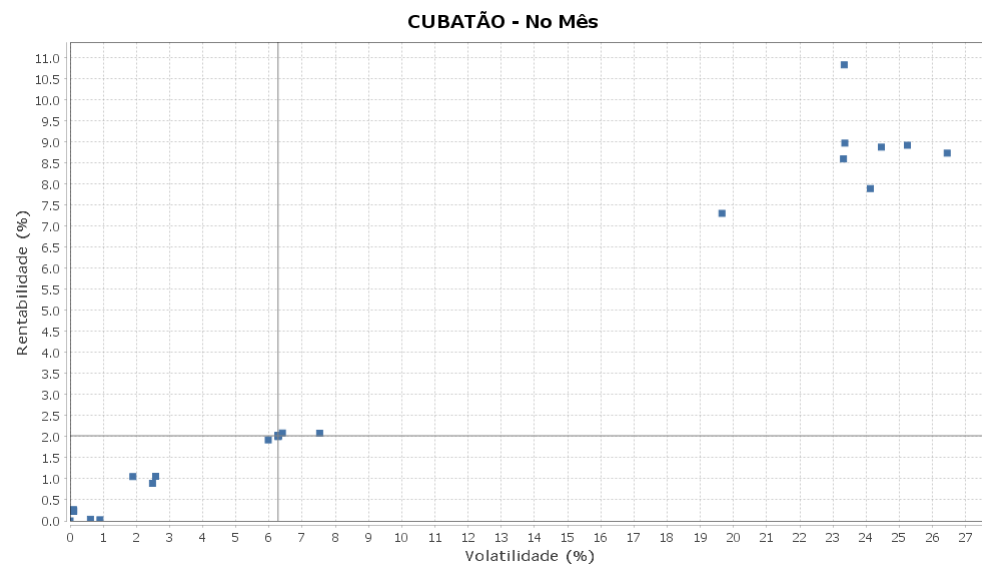
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
75	03/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	200.000,00	0,00	74.264,43819800	2,6930790140
81	03/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.900.000,00	0,00	1.819.478,73587300	2,6930790140
89	03/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.150.000,00	0,00	798.342,71063800	2,6930790140
79	05/06/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000,00	39,08728164	25,5837694000
87	05/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	22.800,00	123,41785669	184,7382592000
76	08/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	62.000,00	23.017,20536000	2,6936371740
82	08/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.250.000,00	835.301,80742900	2,6936371740
94	08/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	10.200,00	55,20972198	184,7500700000
92	15/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	490.000,00	0,00	181.812,68473300	2,6950814830
77	16/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	161.600,00	59.952,49007800	2,6954676910
83	16/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.510.000,00	931.192,76049200	2,6954676910
95	16/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	13.400,00	72,48743127	184,8596338000
84	22/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	140.000,00	0,00	51.909,66997600	2,6969926810
91	22/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	334.000,00	0,00	123.841,64122900	2,6969926810
86	25/06/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.973,28	0,00	311,24344459	25,6175034000
80	29/06/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.800,00	148,32035647	25,6202189000
88	29/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	116.000,00	628,10994221	184,6810442000
96	29/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	31.800,00	172,18876002	184,6810442000
78	30/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.500,00	0,00	4.632,42698200	2,6983695690
85	30/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	133.000,00	0,00	49.289,02309300	2,6983695690
93	30/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.700,00	0,00	2.112,38670300	2,6983695690
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 63.729.313,41

Value-At-Risk: 8,21%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,17	-0,00	0,59	0,26	13.092.182,85	1,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,33	0,01	0,44	0,26	43.687.841,02	5,63
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,33	0,00	0,44	0,26	1.017.876,79	0,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,33	0,03	0,41	0,26	109.316.502,69	14,08
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,33	0,01	0,12	0,23	19.005.943,67	2,45
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,62	0,24	-0,00	-0,28	0,04	47.114.569,65	6,07
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,90	0,39	0,00	-0,21	0,03	8.088.212,99	1,04
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,89	2,85	0,05	0,44	1,05	17.141.290,92	2,21
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,49	3,68	0,07	0,27	0,89	15.564.425,44	2,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,58	3,74	0,30	0,33	1,06	66.459.208,18	8,56
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,97	9,38	0,23	0,29	1,92	19.650.158,19	2,53
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	6,27	9,52	0,37	0,29	2,02	31.673.022,38	4,08
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	9,57	0,34	0,29	2,02	29.125.718,28	3,75
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	9,71	0,33	0,29	2,00	27.453.730,62	3,54
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	9,79	0,37	0,29	2,02	30.395.177,89	3,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	9,76	0,71	0,29	2,03	59.164.045,21	7,62
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,28	9,78	0,45	0,29	2,03	37.823.209,12	4,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,40	10,15	0,39	0,29	2,09	31.640.217,75	4,08
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	7,53	9,86	0,69	0,25	2,08	57.337.543,29	7,39
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Artigo 8º IV, Alínea b	19,65	14,75	0,03	0,36	7,30	2.247.750,00	0,29
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	23,32	31,01	0,67	0,36	8,60	18.092.266,85	2,33
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,34	28,41	0,41	0,45	10,83	13.151.480,65	1,69
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,36	29,97	0,83	0,38	8,97	23.371.744,33	3,01
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,13	30,18	0,32	0,32	7,89	8.894.113,96	1,15
ARX INCOME FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,46	31,10	0,90	0,35	8,88	24.003.831,67	3,09
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,24	24,92	0,52	0,34	8,92	17.127.487,37	2,21
ITAU INDEX IBOVESPA 1	Artigo 8º II, Alínea a	26,44	32,54	0,18	0,32	8,73	4.557.073,51	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS