



LDB
EMPRESAS

PAULÍNIA
MARÇO 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 01.06.2020.

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

RENDA FIXA

72,24%

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 150824	7,86	-2,68	-1,18	146.080.850,46	12,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,71	-1,72	-0,34	9.007.705,84	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	5,55	-1,87	-0,43	33.498.962,87	2,81
TESOURO NACIONAL	LFT 010920	0,05	0,34	1,01	14.700.511,89	1,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		6,72	-2,29	-0,86	203.288.031,06	17,07

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 ALOC FIC	5,33	-2,10	-1,18	137.018.252,92	11,51	10.536.452.770,12	1,30
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	5,32	-0,13	1,31	212.658.579,33	17,86	11.020.077.699,37	1,93
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,10	-0,91	0,33	349.676.832,25	29,36		

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
BRIDGE	BRIDGE	TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	16,38	-16,59	-16,49	15.639.947,89	1,31	70.344.549,45	22,23
BRIDGE	BRIDGE	TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	31,01	-26,51	-29,15	43.799.349,43	3,68	284.206.952,52	15,41
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			27,18	-24,13	-26,20	59.439.297,32	4,99		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,18	-0,07	0,58	269.634,86	0,02	3.385.573.184,27	0,01
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	-0,03	0,18	6.859.548,06	0,58	2.725.355.805,79	0,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,32	0,53	1,13	67.496.359,98	5,67	5.019.962.419,71	1,34
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	2,12	0,09	0,70	55.229.878,09	4,64	877.373.790,60	6,29
TMJ	RJI	TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	12,52	-100,00	-9,07	27.325.930,82	2,29	184.808.854,48	14,79
FMD	FMD	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	16,30	-8,15	-10,07	11.066.208,62	0,93	35.101.712,23	31,53
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			26,86	-2,45	-1,91	168.247.560,43	14,13		

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	SANTANDER	BBIF MASTER FIDC LP	17,74	-0,51	-1,56	116.908,62	0,01	20.861.442,43	0,56
GGR	CM CAPITAL	GBX PRIME I FIDC	16,92	-0,31	-1,01	12.678.118,37	1,06	175.690.651,27	7,22
GRAPHEN	ORLA	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,52	-1,29	-2,07	5.931.284,48	0,50	74.701.319,41	7,94
PLANNER	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	5,39	-2,50	-4,62	29.485.226,59	2,48	170.906.783,18	17,25
RJI	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B	473,31	0,00	0,00	0,00	0,00	149.178,79	0,00
RJI	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	4,74	-0,14	-0,31	14.292.821,55	1,20	56.797.793,09	25,16
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			4,84	-1,41	-2,53	62.504.359,61	5,25		

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
BRPP	INTRADER	PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	32,38	-0,20	-1,05	17.105.530,07	1,44	113.413.604,77	15,08
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			32,38	-0,20	-1,05	17.105.530,07	1,44		
Renda Fixa			7,12	-3,58	-3,01	860.261.610,74	72,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,76%

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	38,99	-29,74	-36,64	26.448.526,48	2,22	219.974.851,56	12,02
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	40,65	-31,54	-39,89	41.305.165,66	3,47	557.582.118,41	7,41
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	34,66	-29,46	-33,99	39.157.330,07	3,29	1.330.411.885,84	2,94
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	41,23	-30,69	-36,11	24.850.435,39	2,09	777.057.191,68	3,20
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	38,15	-31,06	-36,21	30.616.889,52	2,57	1.171.296.538,03	2,61
ITAU	ITAU	ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	38,94	-32,44	-39,18	44.790.971,06	3,76	2.717.755.336,40	1,65
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			38,33	-30,96	-37,15	207.169.318,18	17,40		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
FMD	FMD	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	12,60	-10,64	-10,14	36.429.135,01	3,06	180.263.648,14	20,21
Sub-total Artigo 8º III			12,60	-10,64	-10,14	36.429.135,01	3,06		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,40	0,00	-0,03	15.715.667,34	1,32	267.517.064,75	5,87
CABEDAL	CABEDAL	FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,03	-0,01	-0,01	25.032.889,93	2,10	1.470.519.157,30	1,70
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	1,20	-0,17	-0,49	2.087.595,84	0,18	136.709.403,75	1,53
RJI	RJI	ÁTICO GESTÃO EMPRESARIAL - FIP	52,76	-0,80	-0,74	633.734,45	0,05	4.338.659,48	14,61
ATICO	BNY MELLON	ATICO FLORESTAL - FI EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	10,36	-0,14	-0,39	3.631.049,93	0,30	115.542.443,55	3,14
INFRA ASSET	INFRA ASSET	INFRA SANEAMENTO - FUNDO INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÕES	11,50	-0,18	-0,46	13.081.287,22	1,10	410.573.286,77	3,19
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			2,79	-0,06	-0,16	60.182.224,71	5,05		

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
BRIDGE	ELITE	BR HOTÉIS FII	0,33	-0,06	-0,25	13.175.344,12	1,11	157.758.832,26	8,35
INFRA ASSET	INFRA ASSET	FII INFRA REAL ESTATE - FII	0,84	-0,20	0,64	1.458.449,84	0,12	117.432.760,77	1,24
RJI	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	0,27	0,06	0,15	12.144.854,76	1,02	70.521.190,50	17,22
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			0,21	-0,02	-0,02	26.778.648,72	2,25		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			24,76	-22,73	-27,74	330.559.326,62	27,76		
Total						1.190.820.937,36	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	203.288.031,06	17,07				100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	349.676.832,25	29,36				100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	59.439.297,32	4,99				65,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	168.247.560,43	14,13				45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	62.504.359,61	5,25				5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	17.105.530,07	1,44				10,00
	Total Renda Fixa	860.261.610,74	72,24				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	207.169.318,18	17,40				25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	36.429.135,01	3,06				10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	60.182.224,71	5,05				5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	26.778.648,72	2,25				5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	330.559.326,62	27,76				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

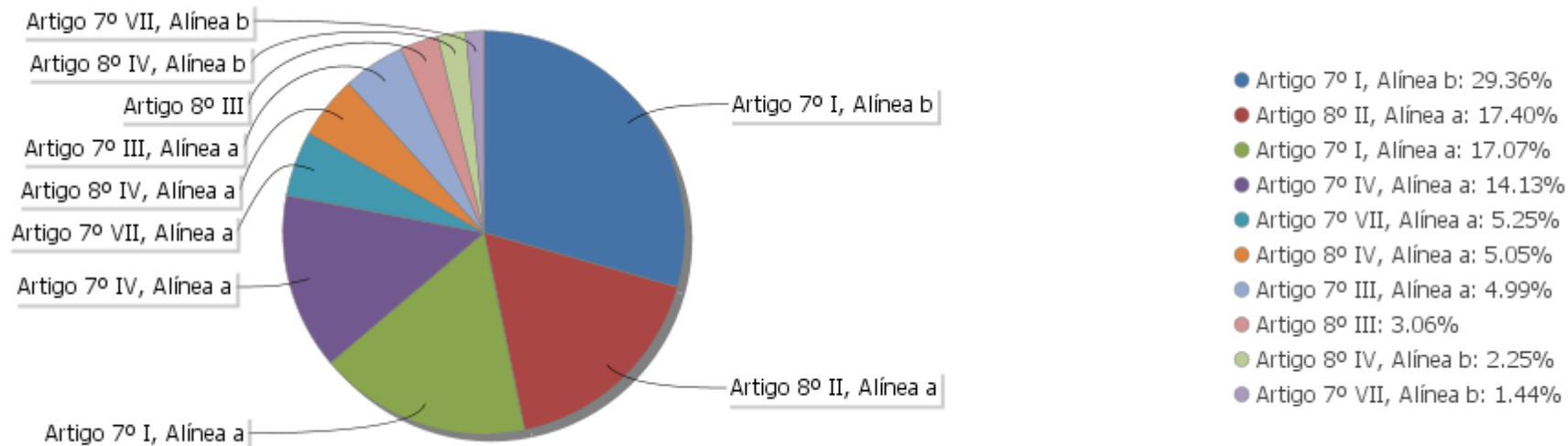
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-2,29 -677,21	-0,86 -85,06	-0,86 -85,06	1,89 83,37	11,16 205,22	-4.767.533,11	-1.705.456,45
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,91 -269,51	0,33 32,71	0,33 32,71	2,61 115,25	10,08 185,35	-3.217.403,22	1.285.186,40
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-24,13 -7.131,95	-26,20 -2.588,95	-26,20 -2.588,95	-24,87 -1.098,67	-20,91 -384,58	-18.906.772,99	-21.104.773,25
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-2,45 -723,99	-1,91 -188,95	-1,91 -188,95	-1,19 -52,45	4,41 81,11	-4.464.560,97	-3.482.811,44
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-1,41 -416,57	-2,53 -249,64	-2,53 -249,64	-2,93 -129,33	-1,56 -28,74	-893.635,41	-1.595.967,90
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,20 -59,66	-1,05 -103,64	-1,05 -103,64	31,42 1.387,64	32,28 593,76	-34.167,94	-187.912,57
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,96 -1,05	-37,15 -0,29	-37,15 -0,29	-30,35 -0,06	-21,08 2,39	-92.882.596,08	-123.147.232,41
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-10,64 19,26	-10,14 26,71	-10,14 26,71	-10,40 19,89	-16,46 7,01	-4.338.085,86	-4.112.608,71
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,06 29,84	-0,16 36,70	-0,16 36,70	0,79 31,08	0,14 23,61	-38.577,01	-97.515,10
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,02 29,89	-0,02 36,84	-0,02 36,84	-0,11 30,18	-0,18 23,29	-4.069,10	-6.277,16
						-129.547.401,69	-154.155.368,59

Análise de Liquidez

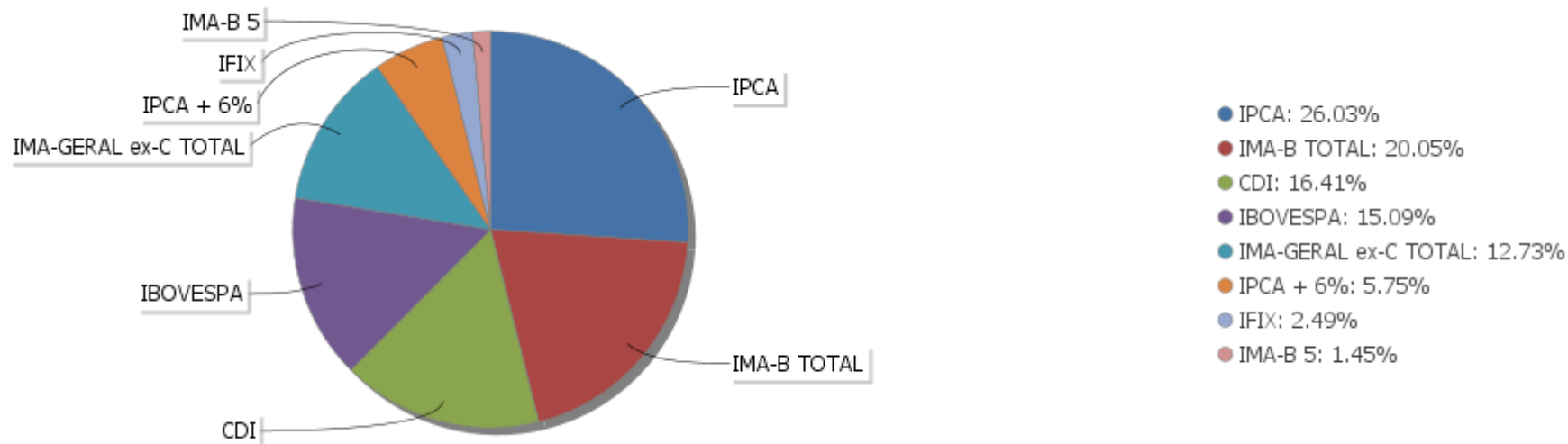
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	660.059.658,83	55,43	660.059.658,83	55,43
de 31 a 364 dias	114.958.807,86	9,65	775.018.466,69	65,08
acima de 365 dias	415.802.470,67	34,92	1.190.820.937,36	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

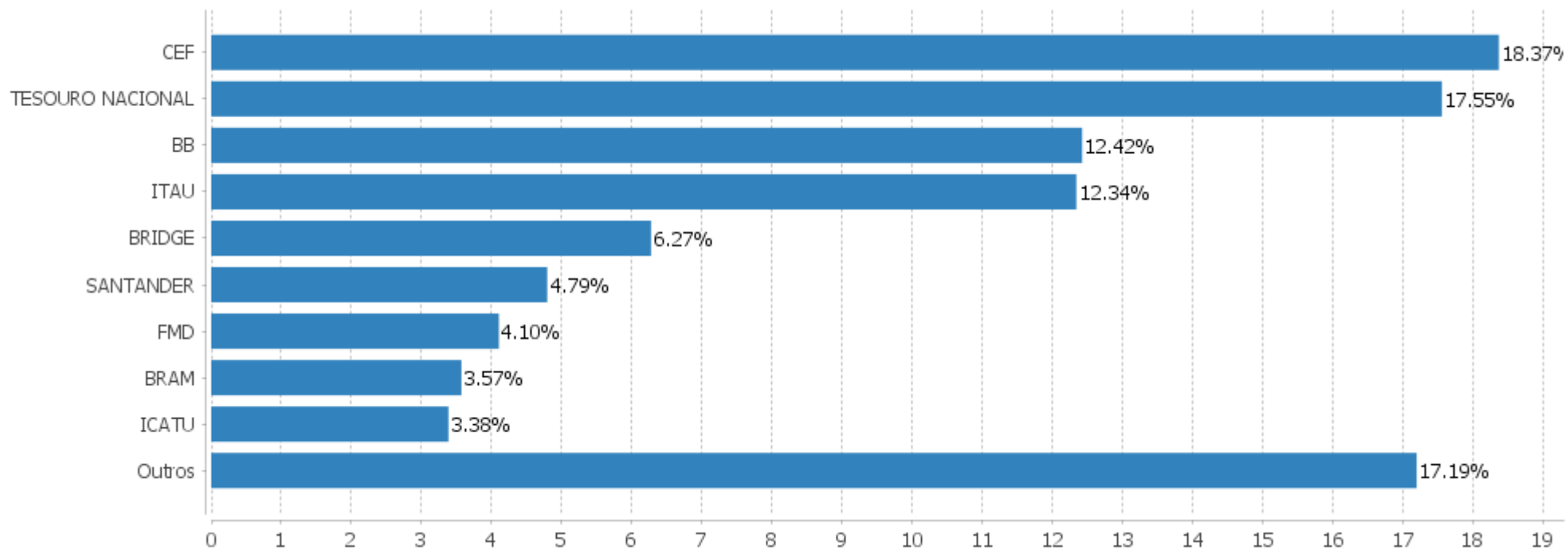


Alocação Por Estratégia



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	0,19	-2,02	-9,75										-11,40
IPCA + 6%	0,72	0,67	0,58										1,98
p.p. indexador	-0,53	-2,69	-10,33										-13,38
2019	1,46	-0,24	-0,07	0,78	1,32	1,97	0,70	0,08	1,48	1,61	0,10	2,21	12,00
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,63	-1,14	-1,26	-0,28	0,68	1,52	-0,02	-0,54	1,04	0,98	-0,87	0,57	1,41

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

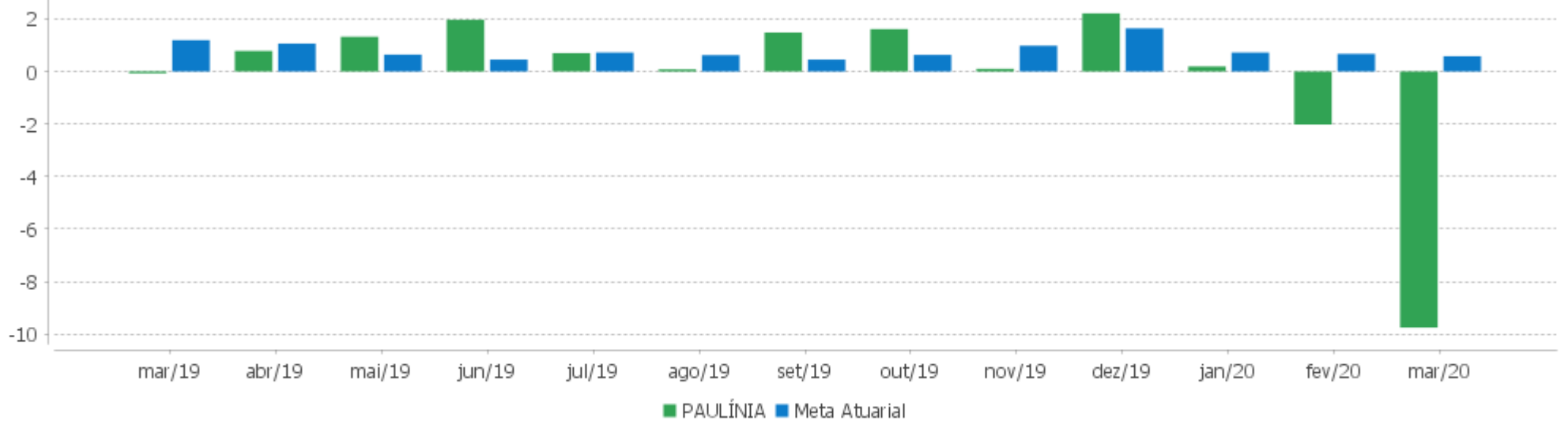
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	40,00	03 meses	-11,40	1,98	-13,38	21,54
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	60,00	06 meses	-7,88	5,33	-13,21	15,37
			12 meses	-1,89	9,55	-11,44	11,07
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,21	2019-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-9,75	2020-03	Desde 31/12/2018	-0,77	12,78	-13,55	10,07

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
SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS % do CDI	0,09 27,22	0,70 69,29	0,70 69,29	3,07 135,41	10,94 201,23	16,52 136,23	
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	-0,03 -9,77	0,59 58,36	0,59 58,36	1,74 76,63	4,81 88,50	11,34 93,51	20,78 96,50
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-10,33 -3,36	-9,07 -2,76	-9,07 -2,76	-7,22 -3,57	0,85 -8,29	-6,88 -30,98	
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	-8,15	-10,07	-10,07	-14,68	-13,49	-29,82	
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	-0,07 -21,48	0,58 57,61	0,58 57,61	1,69 74,75	4,81 88,50	11,43 94,27	20,92 97,16
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,53 0,46	1,13 0,60	1,13 0,60	2,34 0,03	9,75 6,45	18,58 10,56	30,29 19,37
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-16,59 -14,83	-16,49 -15,92	-16,49 -15,92	-15,90 -17,93	-12,02 -21,36	-25,11 -44,50	-18,64 -52,31
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	-26,51	-29,15	-29,15	-27,63	-23,66	-41,11	
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II % do CDI	-0,14 -42,80	-0,31 -30,51	-0,31 -30,51	-0,65 -28,86	2,59 47,73	1,86 15,35	
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	108,03 4.771,57	-94,36 -1.735,51	-94,36 -778,26	
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-1,29 -380,46	-2,07 -204,53	-2,07 -204,53	-2,89 -127,55	-2,15 -39,62	1.179,81 9.730,80	
BBIF MASTER FIDC LP % do CDI	-0,51 -151,41	-1,56 -153,70	-1,56 -153,70	-3,09 -136,50	4,79 88,19	-31,66 -261,16	-98,14 -455,81
ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6% p.p.	-2,50 -3,08	-4,62 -6,60	-4,62 -6,60	-5,89 -11,22	-3,48 -13,03	-11,53 -32,91	
GBX PRIME I FIDC % do CDI	-0,31 -92,20	-1,01 -99,91	-1,01 -99,91	-0,19 -8,58	-2,87 -52,70	-21,37 -176,21	-24,49 -113,73
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,68 4,29	-1,18 5,13	-1,18 5,13	1,73 5,38	12,16 3,02	23,17 -0,93	39,23 1,81
LFT 010920	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,71
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,72 5,26	-0,34 5,97	-0,34 5,97	2,15 5,80	10,34 1,20	20,78 -3,33	36,64 -0,79
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,87 5,10	-0,43 5,88	-0,43 5,88	2,29 5,93	11,49 2,35	22,82 -1,28	38,41 0,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	-0,20 -59,66	-1,05 -103,64	-1,05 -103,64	31,42 1.387,64	32,28 593,76	29,81 245,86	-30,59 -142,08
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-2,10 -0,17	-1,18 -0,17	-1,18 -0,17	0,61 -0,26	8,55 0,22	18,63 0,23	30,83 -0,39
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,13 -0,20	1,31 0,78	1,31 0,78	3,13 0,82	13,46 10,16	23,65 15,62	35,73 24,81
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO % do CDI	-10,64 -3.144,82	-10,14 -1.002,29	-10,14 -1.002,29	-10,40 -459,44	-16,46 -302,81	-23,39 -192,93	
GERAÇÃO FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-29,74 0,16	-36,64 0,22	-36,64 0,22	-30,61 -0,32	-23,56 -0,09	-14,78 -0,31	-8,12 -20,48
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-31,54 -1,63	-39,89 -3,03	-39,89 -3,03	-34,30 -4,01	-26,99 -3,52	-17,46 -3,00	19,95 7,59
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-31,06 -1,15	-34,96 1,90	-34,96 1,90	-26,97 3,32	-16,95 6,52	-1,94 12,52	28,49 16,13
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-30,69 -0,78	-36,11 0,75	-36,11 0,75	-28,12 2,17	-21,54 1,93	-9,49 4,98	19,44 7,07
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-32,44	-39,18	-39,18	-31,38	-17,47	-4,42	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-29,46 0,44	-33,99 2,87	-33,99 2,87	-27,38 2,91	-13,81 9,66	1,70 16,16	29,39 17,02
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,17 -51,05	-0,49 -48,02	-0,49 -48,02	-0,99 -43,52	-1,98 -36,36	-3,95 -32,57	
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA Var. IPCA + 6% p.p.	0,00 -0,58	-0,03 -2,01	-0,03 -2,01	-0,12 -5,45	0,13 -9,42	0,75 -20,63	-21,24 -53,20
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,01 -2,01	-0,01 -0,93	-0,01 -0,93	-0,03 -1,33	-0,06 -1,12	-0,18 -1,52	-0,18 -0,83
ÁTICO GESTÃO EMPRESARIAL - FIP % do CDI	-0,80 -235,70	-0,74 -73,55	-0,74 -73,55	42,66 1.884,07	-4,40 -80,92	-7,85 -64,78	
INFRA SANEAMENTO - FUNDO INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÕES Var. IPCA + 6% p.p.	-0,18 -0,76	-0,46 -2,45	-0,46 -2,45	-0,85 -6,18	-1,25 -10,81	-2,91 -24,29	-4,78 -36,75
ATICO FLORESTAL - FI EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,14 -0,72	-0,39 -2,37	-0,39 -2,37	10,90 5,57	9,84 0,28	-33,58 -54,96	-34,59 -66,55
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO Var. IFIX p.p.	0,06 15,91	0,15 22,15	0,15 22,15	0,20 7,28	0,15 -0,30	16,64 10,85	
BR HOTÉIS FII Var. IFIX p.p.	-0,06 15,78	-0,25 21,75	-0,25 21,75	-0,48 6,60	-0,58 -1,03	-5,76 -11,55	4,07 -18,62
FII INFRA REAL ESTATE - FII	-0,20	0,64	0,64	0,82	0,64	-3,23	

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.	15,65	22,64	22,64	7,91	0,19	-9,02	
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

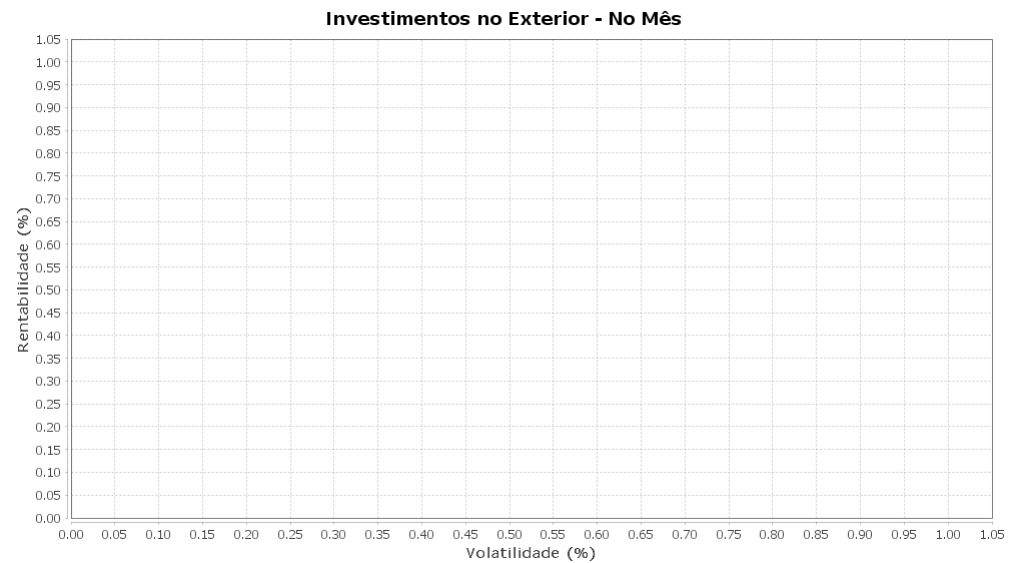
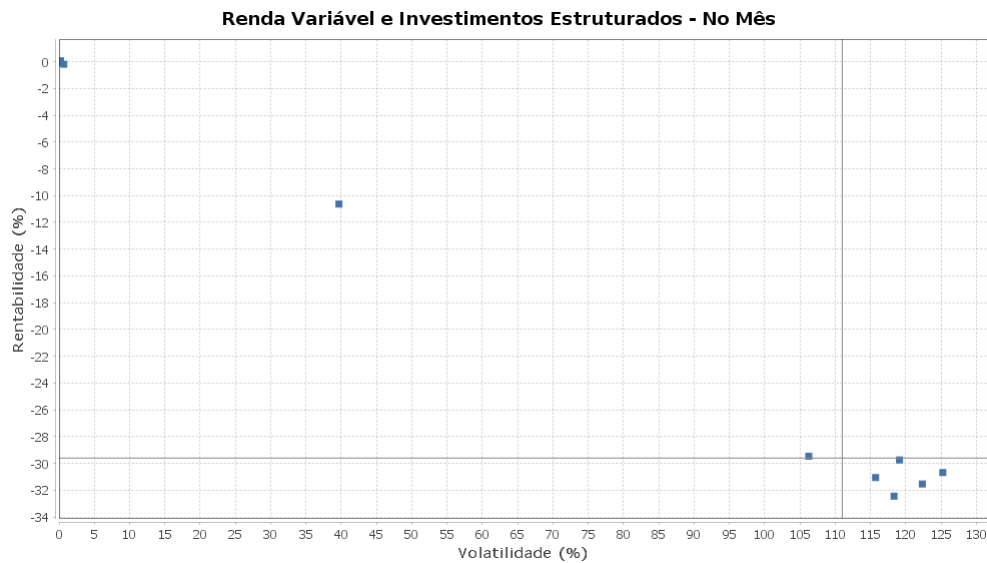
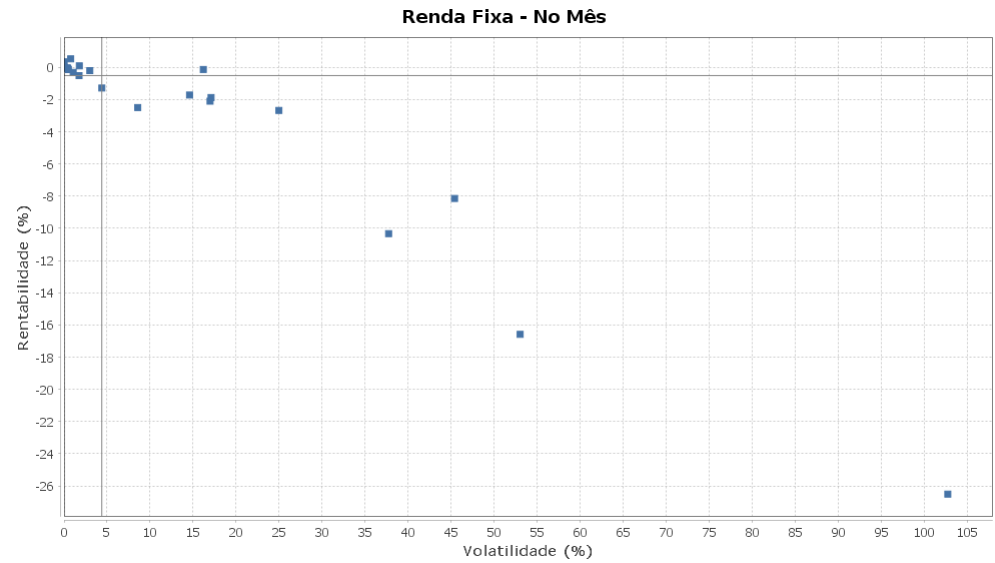
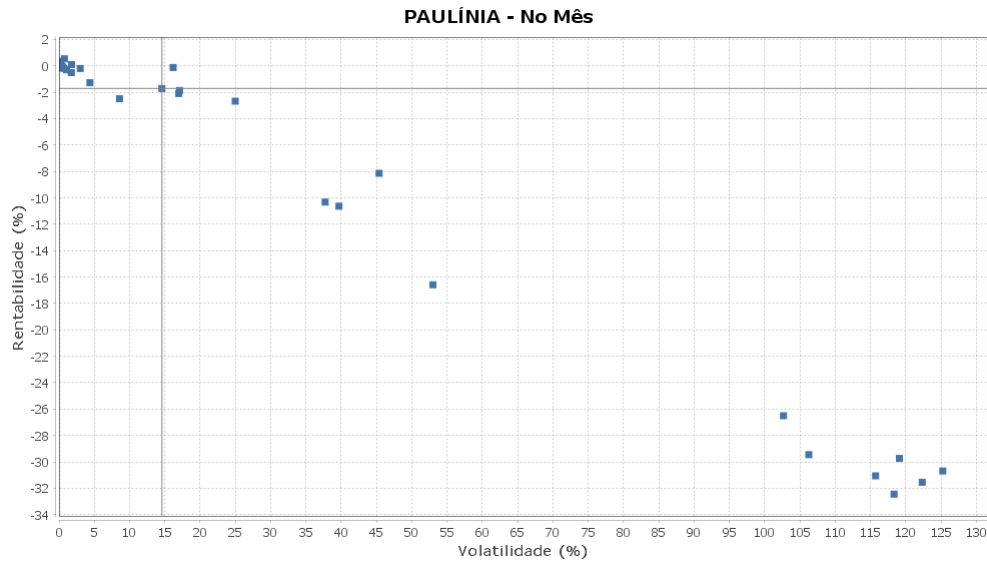
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
04/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	0,00	421.355,22	290.464,39652300	1,4506260493
05/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	6.330.374,04	0,00	34.337,60956200	184,3568647000
05/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.616,49	14,19252900	184,3568647000
05/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	3.000,00	16,27278800	184,3568647000
05/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.428.207,27	0,00	1.514.745,15741900	2,2632237860
05/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	0,00	4.500,00	3.113,55780900	1,4452890000
06/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	37.529,46	203,54620800	184,3780855000
06/03/2020	BB PREV ALOC FIC	116.663,14	0,00	79.290,23634300	1,4713430730
09/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	3.658,41	19,83879000	184,4069123000
10/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	999,85	5,42132100	184,4292322000
10/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	16.876,52	91,50675200	184,4292322000
10/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	761.287,36	0,00	528.346,69779500	1,4408860000
11/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.753,59	14,92808300	184,4570508000
13/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	40.142,00	217,61789500	184,4609333000
13/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	388.148,48	2.104,23135800	184,4609333000
13/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	5.370,19	29,11288600	184,4609333000
17/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.413,95	13,08102900	184,5382402000
20/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	828.254,05	0,00	4.487,96924000	184,5498500000
20/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.536,42	24,58100100	184,5498500000
20/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.247.871,42	6.761,70378900	184,5498500000
23/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	1.233,69	0,00	6,68702600	184,4900927000
23/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	11.035,63	59,81692500	184,4900927000
23/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	6.619,03	35,87742800	184,4900927000
26/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	8.639,53	46,86445300	184,3514544000
26/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.232,76	6,68702600	184,3514544000
27/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	3.896,27	21,14078500	184,3011041000
27/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	86.803,32	0,00	60.649,32823600	1,4312330000
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.144.209,26	6.214,28799400	184,1255605000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.121.985,58	6.093,58952200	184,1255605000
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	814.837,85	4.425,44671300	184,1255605000
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.575.895,87	24.852,04045000	184,1255605000
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	301.559,66	1.637,79357600	184,1255605000
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	494.648,91	2.686,47607300	184,1255605000
30/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	0,00	422.246,23	294.006,88590800	1,4361780000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT 010920	Artigo 7º I, Alínea a	0,01	0,02	0,34	14.700.511,89	1,23
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,20	0,02	0,06	12.144.854,76	1,02
BR HOTÉIS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,22	0,02	-0,06	13.175.344,12	1,11
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	-0,03	6.859.548,06	0,58
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,44	0,04	-0,07	269.634,86	0,02
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	Artigo 7º VII, Alínea a	0,49	0,04	-0,14	14.292.821,55	1,20
FII INFRA REAL ESTATE - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,67	0,06	-0,20	1.458.449,84	0,12
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	0,10	0,53	67.496.359,98	5,67
GBX PRIME I FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	1,06	0,10	-0,31	12.678.118,37	1,06
BBIF MASTER FIDC LP	Artigo 7º VII, Alínea a	1,74	0,16	-0,51	116.908,62	0,01
SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	Artigo 7º IV, Alínea a	1,78	0,19	0,09	55.229.878,09	4,64
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	3,00	0,30	-0,20	17.105.530,07	1,44
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	4,39	0,40	-1,29	5.931.284,48	0,50
ILLUMINATI FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	8,56	0,77	-2,50	29.485.226,59	2,48
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	14,58	1,43	-1,72	9.007.705,84	0,76
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	1,67	-0,13	212.658.579,33	17,86
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	16,96	1,66	-2,10	137.018.252,92	11,51
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	17,08	1,68	-1,87	33.498.962,87	2,81
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	24,97	2,46	-2,68	146.080.850,46	12,27
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	37,72	3,41	-10,33	27.325.930,82	2,29
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	Artigo 8º III	39,66	3,60	-10,64	36.429.135,01	3,06
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	Artigo 7º IV, Alínea a	45,37	4,31	-8,15	11.066.208,62	0,93
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	Artigo 7º III, Alínea a	52,99	4,67	-16,59	15.639.947,89	1,31
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	Artigo 7º III, Alínea a	102,68	9,24	-26,51	43.799.349,43	3,68
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	106,26	9,42	-29,46	39.157.330,07	3,29
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	115,72	10,30	-31,06	30.616.889,52	2,57
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	118,33	10,48	-32,44	44.790.971,06	3,76
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	119,10	10,74	-29,74	26.448.526,48	2,22
BRANCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	122,33	10,95	-31,54	41.305.165,66	3,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	125,25	11,31	-30,69	24.850.435,39	2,09