



LDB
EMPRESAS

PAULÍNIA
JULHO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 23.09.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

69,34%

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	8,61	1,79	5,84	156.460.122,82	12,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,98	0,81	4,32	9.428.870,04	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,05	1,14	5,32	34.515.895,23	2,70
TESOURO NACIONAL	LFT 010920	0,07	0,20	1,96	14.838.606,43	1,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,37	1,53	5,42	215.243.494,52	16,81

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	139.241.864,49	10,87	10.799.663.748,52	1,29
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,98	5,65	232.297.847,94	18,14	12.451.209.797,34	1,87
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,89	1,28	4,82	371.539.712,43	29,02		

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	16,48	0,62	-17,56	15.438.692,32	1,21	69.439.352,78	22,23
BRIDGE	BRIDGE	TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	30,89	-0,04	-31,27	42.485.241,71	3,32	275.679.916,73	15,41
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			27,18	0,13	-28,08	57.923.934,03	4,52		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,31	0,27	1,17	7.801.895,06	0,61	1.691.934.948,09	0,46
CEF	CEF	FIC PRATICO CP	0,02	-0,00	0,00	0,00	0,00	20.774.744.889,09	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,24	1,20	20.723.911,77	1,62	2.412.408.451,26	0,86
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,64	0,55	2,83	68.630.995,11	5,36	5.186.154.771,17	1,32
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,78	0,53	2,53	41.024.460,64	3,20	977.349.938,14	4,20
TMJ	RJI	TMJ IMA-B FI RF	17,20	0,00	-11,50	19.579.191,90	1,53	132.416.643,40	14,79
FMD	FMD	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	16,73	-0,68	-16,77	10.242.154,59	0,80	32.590.013,05	31,43
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			26,97	0,42	-1,24	168.002.609,07	13,12		
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	14,50	15,47	11,57	132.495,83	0,01	20.503.043,81	0,65
GGR	CM CAPITAL	GBX PRIME I FIDC	21,49	-0,21	-3,84	11.261.985,98	0,88	156.066.191,67	7,22
GRAPHEN	ORLA	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,29	-0,41	-3,36	5.853.204,34	0,46	73.717.943,19	7,94
PLANNER	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	6,97	-2,48	-13,22	26.825.190,72	2,10	155.488.276,49	17,25
RJI	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B	443,13	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
RJI	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	0,84	-0,11	-0,67	14.240.762,27	1,11	56.590.916,43	25,16
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			6,36	-1,10	-7,31	58.313.639,14	4,55		
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 FI RF LONGO PRAZO	32,54	-1,15	-1,61	16.767.773,73	1,31	112.078.175,54	14,96
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			32,54	-1,15	-1,61	16.767.773,73	1,31		
Renda Fixa			7,49	0,89	-0,21	887.791.162,92	69,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

30,66%

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	41,90	9,23	-11,31	37.022.427,64	2,89	353.803.988,50	10,46
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	43,38	10,05	-16,95	57.071.379,25	4,46	711.621.761,40	8,02
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,76	4,36	-16,57	49.491.212,55	3,87	1.602.131.208,86	3,09
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,13	10,35	-8,92	35.424.971,05	2,77	1.108.758.492,93	3,20
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	41,24	9,40	-8,43	43.954.548,92	3,43	1.826.640.201,67	2,41
ITAU	ITAU	ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	43,06	7,54	-16,38	61.573.823,45	4,81	3.482.474.100,00	1,77
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,57	8,31	-13,67	284.538.362,86	22,22		

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	11,93	-0,17	-11,49	35.881.767,78	2,80	177.555.090,47	20,21
Sub-total Artigo 8º III			11,93	-0,17	-11,49	35.881.767,78	2,80		

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	243,84	-0,48	-96,87	491.328,06	0,04	8.392.454,80	5,85
CABEDAL	CABEDAL	FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,04	0,03	-0,00	25.035.004,75	1,96	1.470.643.389,47	1,70
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	1,20	-0,18	-1,14	2.073.860,18	0,16	135.394.292,29	1,53
RJI	RJI	ÁTICO GESTÃO EMPRESARIAL - FIP	52,98	-1,82	-0,41	635.850,09	0,05	4.353.143,53	14,61
QUELUZ	BNY MELLON	ATICO FLORESTAL - FIP MULTIESTRATÉGIA	21,40	-0,14	19,72	4.364.050,02	0,34	139.067.643,69	3,14
INFRA ASSET	RJI	INFRA SANEAMENTO - FIP	9,60	-0,18	-1,06	13.002.636,57	1,02	408.104.733,51	3,19
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			22,91	-0,09	-24,35	45.602.729,67	3,56		

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	0,37	-0,12	-0,72	13.112.962,05	1,02	157.011.882,34	8,35
INFRA ASSET	INFRA ASSET	FII INFRA REAL ESTATE - FII	23,37	-10,84	-27,12	1.056.210,55	0,08	85.044.899,68	1,24
RJI	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	2,24	0,03	2,39	12.416.688,38	0,97	72.099.639,24	17,22
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,57	-0,53	-0,66	26.585.860,98	2,08		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			27,66	5,82	-14,17	392.608.721,29	30,66		
Total						1.280.399.884,21	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	215.243.494,52	16,81	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	371.539.712,43	29,02	0,00	40,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	57.923.934,03	4,52	0,00	3,00	60,00	65,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	168.002.609,07	13,12	0,00	3,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	58.313.639,14	4,55	0,00	0,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	16.767.773,73	1,31	0,00	0,00	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	887.791.162,92	69,34				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	284.538.362,86	22,22	0,00	25,00	20,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	35.881.767,78	2,80	0,00	0,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	45.602.729,67	3,56	0,00	0,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	26.585.860,98	2,08	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	392.608.721,29	30,66				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

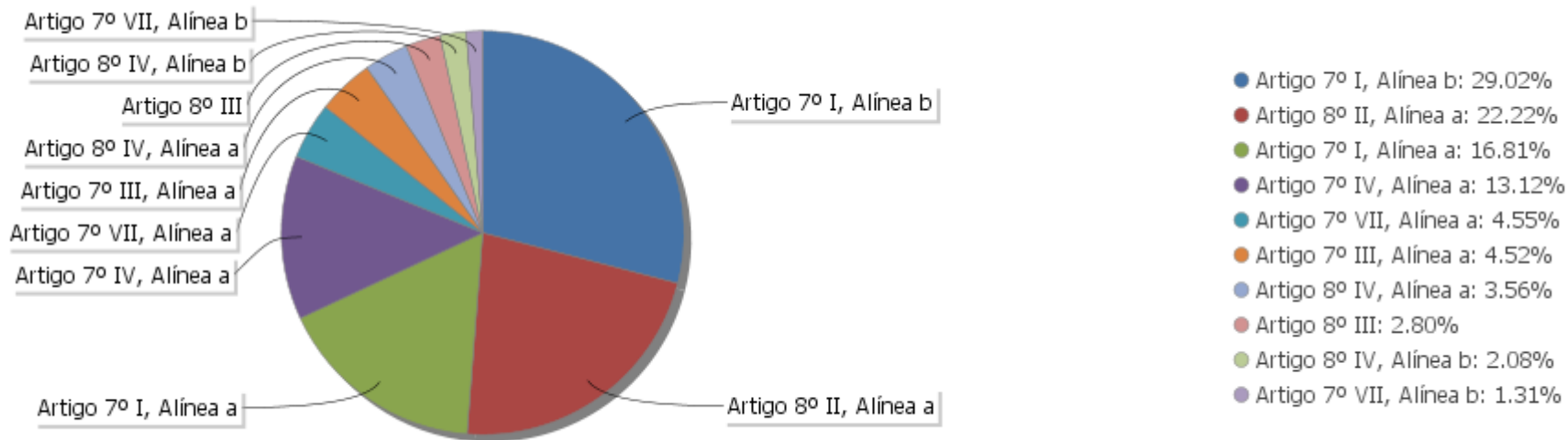
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,53 787,34	5,42 277,68	5,60 870,37	4,63 294,70	10,65 252,69	3.243.818,54	11.128.632,18
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,28 657,55	4,82 246,72	3,40 528,28	4,09 260,57	9,07 215,11	4.649.508,77	16.949.973,29
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,13 67,84	-28,08 -1.438,65	-2,82 -437,36	-28,27 -1.801,36	-26,44 -627,44	76.265,88	-22.620.136,54
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,42 214,68	-1,24 -63,28	0,55 86,02	-1,49 -95,03	0,59 13,92	741.881,33	-2.239.981,71
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-1,10 -567,96	-7,31 -374,71	-3,14 -488,23	-6,84 -435,82	-7,69 -182,43	-629.061,91	-4.632.102,78
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-1,15 -591,26	-1,61 -82,43	-0,58 -89,78	-0,84 -53,68	32,36 767,77	-193.160,98	-280.193,12
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,31 0,04	-13,67 -2,66	26,09 -1,75	-13,40 -3,87	-0,80 -1,88	21.820.372,55	-45.778.187,73
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,17 -8,44	-11,49 -0,48	-1,77 -29,60	-11,53 -2,00	-13,29 -14,37	-62.896,85	-4.659.975,94
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,09 -8,35	-24,35 -13,34	-5,34 -33,17	-24,31 -14,78	-24,01 -25,09	-39.918,99	-14.677.010,14
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,53 -8,79	-0,66 10,35	0,43 -27,40	-0,57 8,97	-0,72 -1,80	-140.559,34	-176.452,43
						29.466.249,00	-66.985.434,92

Análise de Liquidez

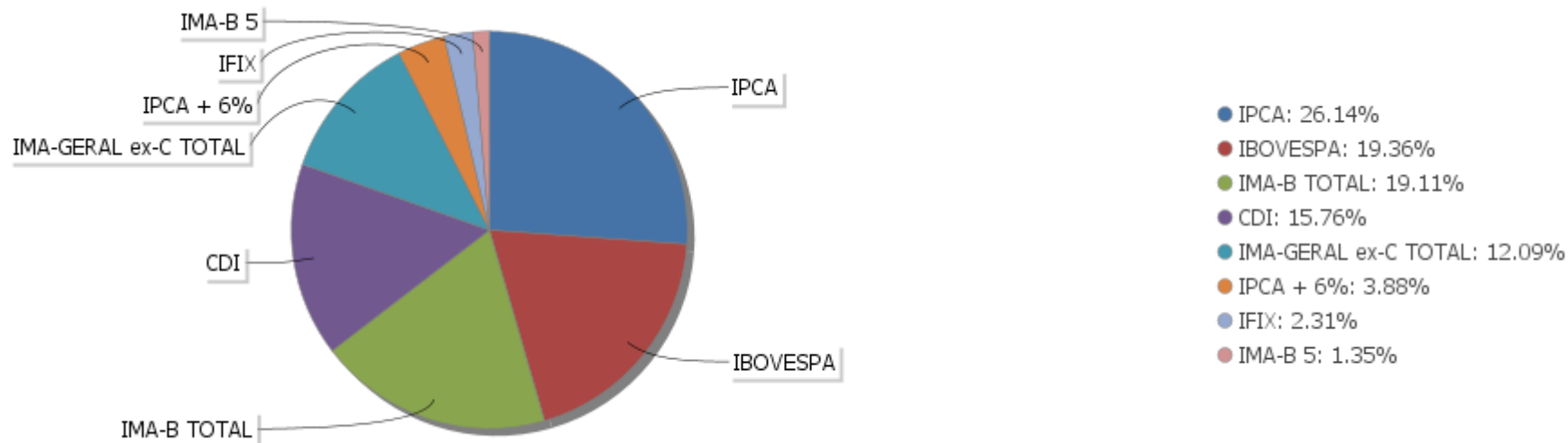
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	694.756.441,59	54,26	694.756.441,59	54,26
de 31 a 364 dias	162.281.004,28	12,67	857.037.445,87	66,94
acima de 365 dias	423.362.438,34	33,06	1.280.399.884,21	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

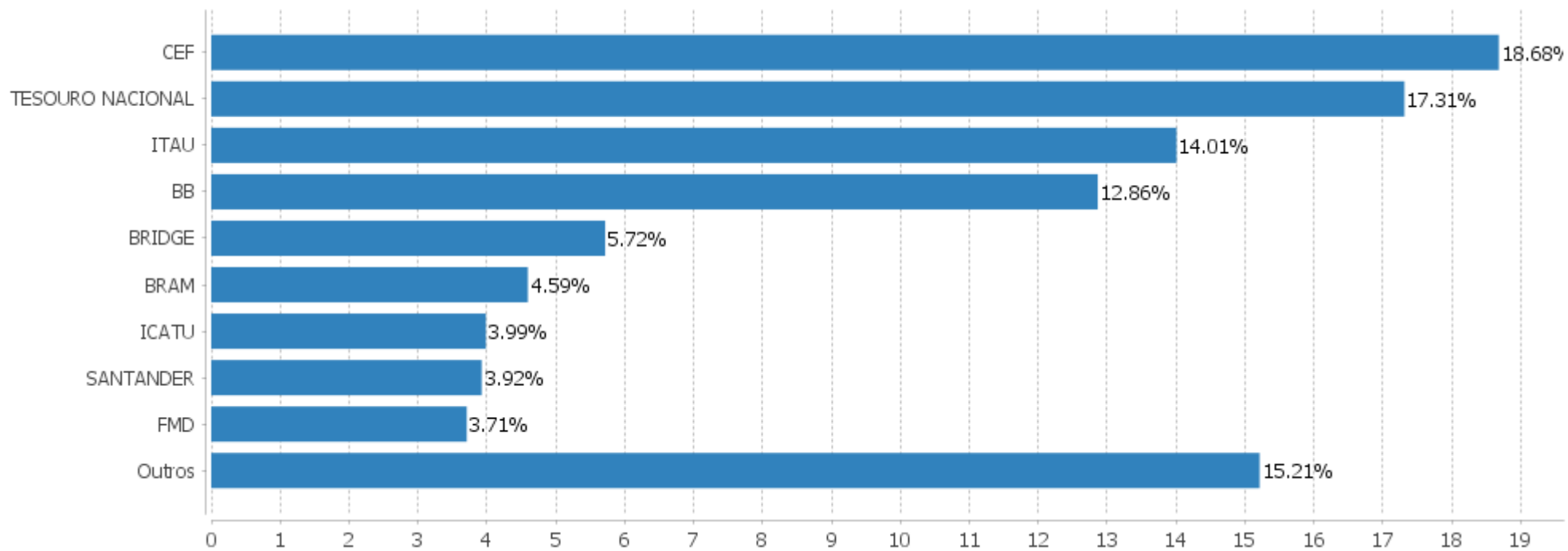


Alocação Por Estratégia



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	0,86	2,11	1,75	2,34						-4,99
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89						3,85
p.p. indexador	-0,52	-2,68	-10,32	0,72	2,03	1,01	1,45						-8,83
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

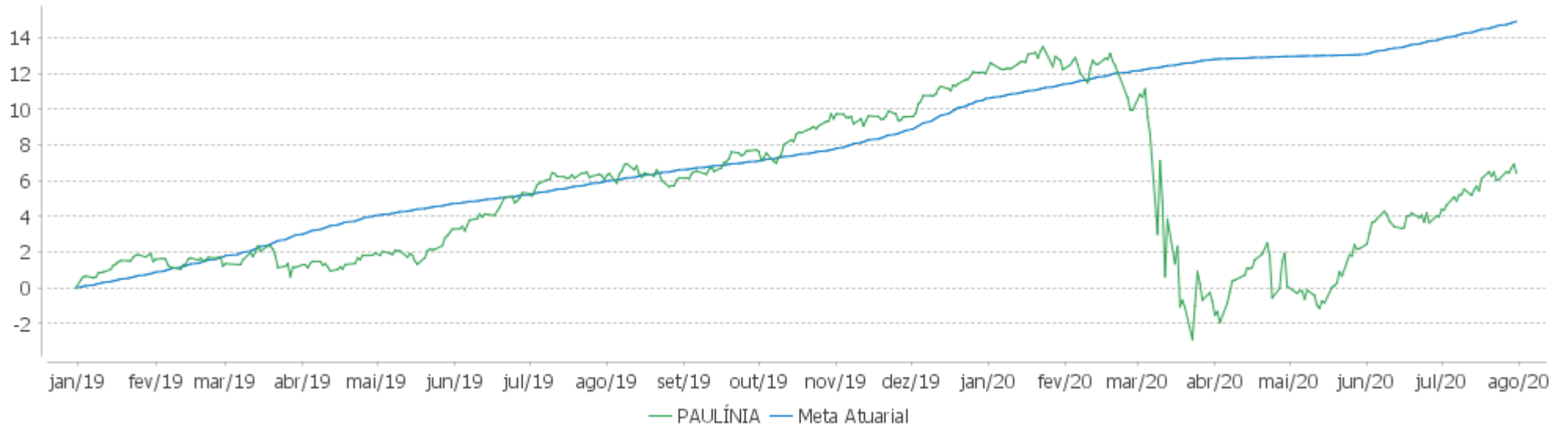
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

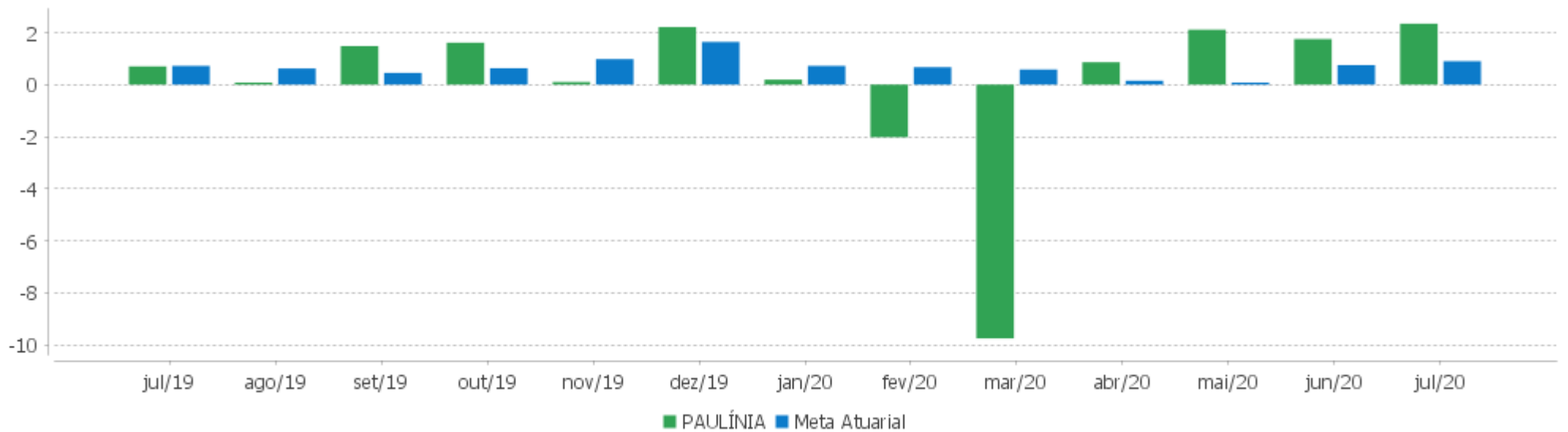
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	10	52,63	03 meses	6,32	1,71	4,62	5,81
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	47,37	06 meses	-5,17	3,11	-8,28	16,80
			12 meses	0,33	8,40	-8,07	12,04
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,34	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-9,75	2020-03	Desde 31/12/2018	6,41	14,84	-8,43	9,79

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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,77 0,11	3,55 0,15	3,83 0,26	3,05 0,17	7,10 0,02	23,78 0,51	32,81 0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,98 0,62	5,65 5,19	3,14 2,90	4,79 4,54	9,68 7,38	28,24 22,64	37,15 26,81
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,62 -0,37	-17,56 -21,76	-1,68 -5,96	-17,59 -21,20	-16,54 -25,37	-14,71 -38,86	-21,72 -56,15
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	-0,04	-31,27	-3,22	-31,50	-29,49	-26,66	
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-1,15 -591,26	-1,61 -82,43	-0,58 -89,78	-0,84 -53,68	32,36 767,77	30,06 277,61	-23,91 -128,04
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II % do CDI	-0,11 -55,08	-0,67 -34,41	-0,26 -40,45	-0,61 -38,67	-0,29 -6,99	1,46 13,47	
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-32,21 -764,33	-94,36 -871,44	
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,41 -212,97	-3,36 -172,08	-1,06 -164,54	-3,26 -207,40	-5,02 -119,18	1.335,45 12.333,26	
BBIF MASTER FIDC LP % do CDI	15,47 7.961,29	11,57 592,65	14,08 2.186,91	12,15 774,39	7,95 188,71	-21,31 -196,77	-56,96 -304,98
GBX PRIME I FIDC % do CDI	-0,21 -109,27	-3,84 -196,81	0,32 49,56	-4,33 -276,01	-7,85 -186,19	-10,96 -101,26	-26,83 -143,64
ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6% p.p.	-2,48 -3,37	-13,22 -17,13	-6,78 -8,51	-12,02 -15,18	-12,84 -21,31	-19,43 -38,05	
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,79 -2,60	5,84 3,19	6,34 -1,80	4,98 2,60	11,43 3,27	33,78 -4,08	43,74 -3,01
LFT 010920	0,20	1,96	0,65	1,58	4,23	10,86	18,76
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,81 -3,58	4,32 1,67	4,18 -3,96	3,64 1,26	8,98 0,82	26,93 -10,93	37,37 -9,38
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14 -3,25	5,32 2,67	4,89 -3,25	4,60 2,22	10,44 2,28	30,85 -7,01	41,08 -5,68
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,53 275,09	2,53 129,38	1,36 211,37	2,18 138,66	6,41 152,04	20,46 188,91	25,05 134,13
FIC PRATICO CP % do CDI	0,01 4,87	0,10 5,04	0,03 5,11	0,06 4,13	0,39 9,21	1,58 14,55	3,51 18,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,24	1,61	0,75	1,26	3,74	10,19	18,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	121,46	82,50	117,07	80,04	88,70	94,14	96,53
TMJ IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 -3,83	-11,50 -14,15	-1,06 -9,20	-11,99 -14,37	-8,25 -16,41	-6,38 -44,25	
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	-0,68	-16,77	-5,11	-15,67	-22,40	-33,87	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,55 0,19	2,83 2,37	1,54 1,30	2,48 2,23	5,21 2,90	19,22 13,62	29,15 18,81
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,27 136,56	1,17 59,99	0,52 81,12	0,79 50,54	3,27 77,58	9,82 90,65	17,59 94,18
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,18 -92,92	-1,14 -58,44	-0,50 -77,92	-0,97 -61,78	-1,97 -46,71	-3,90 -35,97	
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,48 -1,37	-96,87 -100,78	-83,50 -85,23	-96,87 -100,04	-96,87 -105,34	-96,85 -115,47	-97,53 -128,85
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	0,03 14,85	-0,00 -0,05	0,02 2,37	-0,01 -0,33	-0,04 -0,84	-0,14 -1,25	-0,15 -0,79
ÁTICO GESTÃO EMPRESARIAL - FIP % do CDI	-1,82 -938,41	-0,41 -21,16	0,77 120,25	-1,03 -65,83	-2,25 -53,39	-6,28 -57,96	
INFRA SANEAMENTO - FIP Var. IPCA + 6% p.p.	-0,18 -1,07	-1,06 -4,97	-0,51 -2,24	-0,92 -4,08	-1,72 -10,19	-2,83 -21,46	-4,76 -36,08
ATICO FLORESTAL - FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,14 -1,04	19,72 15,81	-0,40 -2,13	19,89 16,72	32,76 24,29	-19,75 -38,38	-20,98 -52,30
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO % do CDI	-0,17 -90,04	-11,49 -588,81	-1,77 -275,15	-11,53 -734,75	-13,29 -315,22	-24,62 -227,38	
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO Var. IFIX p.p.	0,03 2,64	2,39 16,91	2,33 -2,64	2,47 13,65	2,46 -0,31	3,79 -23,07	
BR HOTÉIS FII Var. IFIX p.p.	-0,12 2,48	-0,72 13,80	-0,35 -5,32	-0,60 10,59	-0,93 -3,69	-5,95 -32,81	3,54 -28,74
FII INFRA REAL ESTATE - FII Var. IFIX p.p.	-12,20 -9,59	-27,12 -12,59	-11,99 -16,96	-27,20 -16,01	-26,96 -29,73	-29,58 -56,44	
GERAÇÃO FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	9,23 0,97	-11,31 -0,29	28,24 0,41	-10,18 -0,65	0,46 -0,62	29,38 -0,53	34,99 -21,12
BRANDESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	10,05 1,78	-16,95 -5,94	29,32 1,49	-15,87 -6,33	-6,40 -7,48	22,01 -7,90	57,60 1,49
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	9,40 1,13	-6,63 4,38	29,38 1,55	-7,80 1,73	6,25 5,17	45,40 15,50	79,22 23,10
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,35 2,08	-8,92 2,09	29,17 1,33	-8,39 1,15	5,22 4,14	33,39 3,48	68,54 12,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7,54	-16,38	23,81	-16,23	-0,92	38,66	71,08
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,36 -3,90	-16,57 -5,56	19,15 -8,68	-17,09 -7,55	-4,41 -5,49	43,60 13,69	57,70 1,58
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
Renda Variável							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

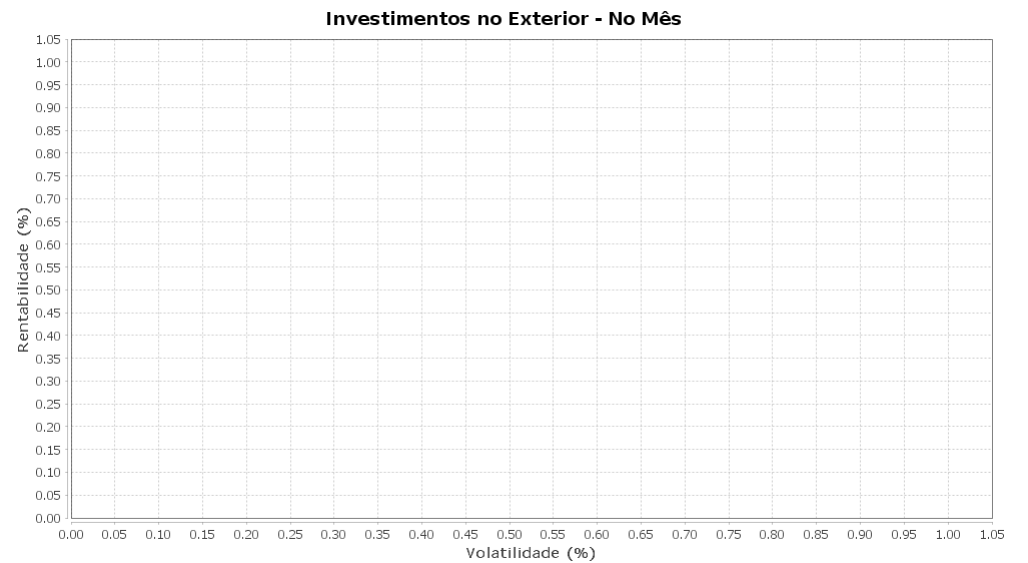
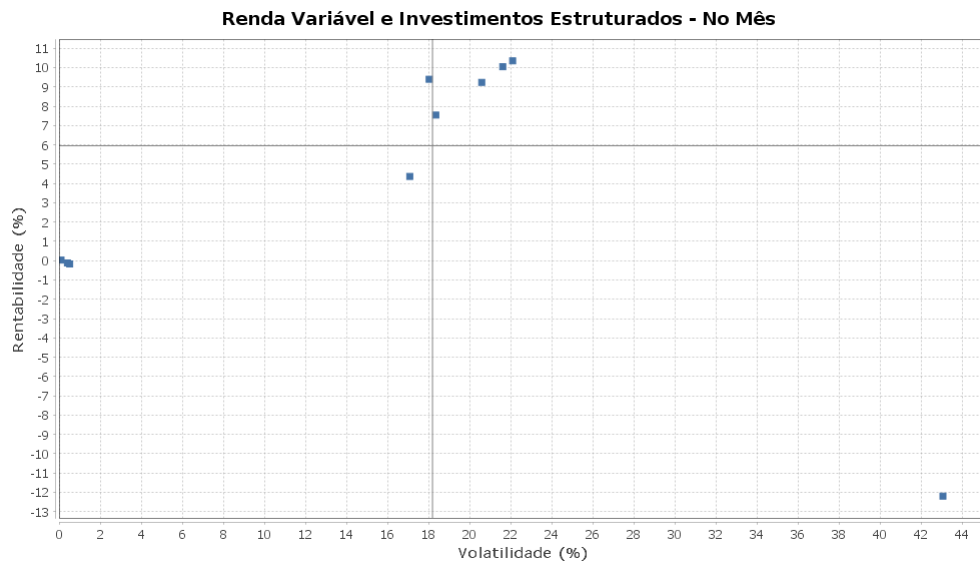
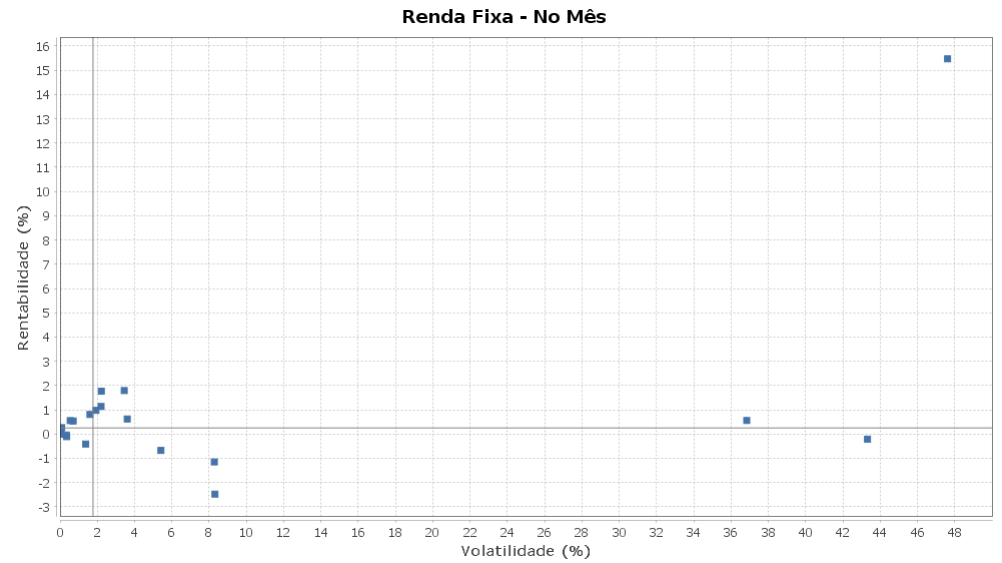
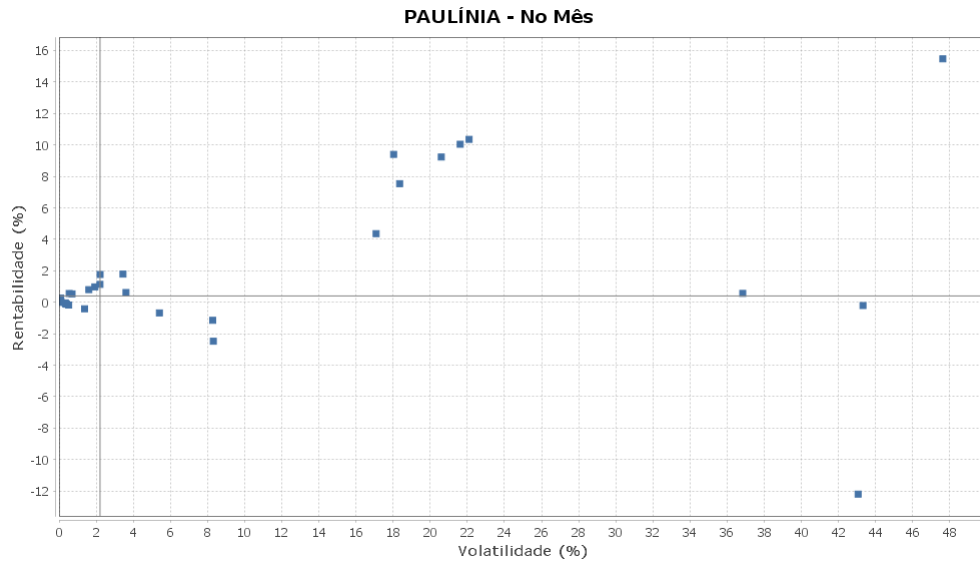
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
224	01/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	436.086,89	293.198,00104300	1,4873460544
227	01/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.774.326,08	0,00	1.192.947,76064200	1,4873460000
222	03/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.387.308,94	0,00	1.485.999,29013800	2,2794822060
201	03/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	6.715.717,50	0,00	36.346,11641100	184,7712538000
206	06/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.434,65	7,76340100	184,7965912000
223	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	40.898,33	0,00	17.938,99549700	2,2798561940
228	07/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	755.700,83	0,00	508.199,52845100	1,4870160000
236	07/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	126.600,00	0,00	85.228,20100900	1,4854238210
202	08/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	5.248,30	0,00	28,39504900	184,8315239000
207	09/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	17.862,11	96,63172800	184,8472586000
208	09/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	5.248,74	28,39504900	184,8472586000
225	09/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	2.000,00	1.345,60860700	1,4863162955
229	09/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	30.754,62	0,00	20.691,98401900	1,4863060000
230	10/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.904,93	0,00	1.950,95824200	1,4889760000
209	13/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.280,69	12,33527400	184,8917238000
210	15/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	48.527,74	262,45672600	184,8980627000
203	15/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	129.529,67	0,00	700,54638900	184,8980627000
231	16/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	18.629,17	0,00	12.518,19856200	1,4881670000
211	17/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	5.453,12	29,48655100	184,9358410000
237	20/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	1.300.051,98	870.225,68354500	1,4939250870
204	20/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	885.948,84	0,00	4.789,89092600	184,9622160000
232	21/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	245.475,81	0,00	164.729,73943200	1,4901730000
212	22/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.551.706,66	13.793,48882300	184,9935642000
213	22/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	124.141,75	671,05983800	184,9935642000
214	22/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	886.098,99	4.789,89092600	184,9935642000
238	22/07/2020	FIC PRATICO CP	1.922.186,59	0,00	321.416,21265300	5,9803660000
233	23/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.922.186,58	0,00	1.290.885,48700600	1,4890450000
239	23/07/2020	FIC PRATICO CP	0,00	1.922.186,58	321.414,86591900	5,9803910000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
215	24/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	22.265,97	120,33660800	185,0307274000
240	24/07/2020	FIC PRATICO CP	0,00	8,05	1,34606043	5,9804150000
216	28/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	15.237,96	82,32526900	185,0945670000
234	29/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.457.449,67	0,00	1.644.234,36991900	1,4945860000
217	30/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	6.205,50	33,51435800	185,1594491000
235	30/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.154.585,58	0,00	770.142,16390900	1,4991850000
218	31/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.122.596,55	22.260,71599500	185,1960445000
219	31/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.564,14	8,44586100	185,1960445000
220	31/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	7.805,50	42,14722900	185,1960445000
221	31/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.054.889,06	21.895,11699500	185,1960445000
226	31/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	419.598,61	279.744,70895100	1,4999340000
205	31/07/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	14.834,86	0,00	80,10354700	185,1960445000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	-	0,00	0,00	0,00
FIC PRATICO CP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	NaN	0,00	-1.398,10	0,01	0,00	0,00
LFT 010920	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,02	-0,00	1,95	0,20	14.838.606,43	1,16
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,10	-0,00	0,78	0,24	20.723.911,77	1,62
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,23	-0,00	0,79	0,27	7.801.895,06	0,61
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,10	0,10	-0,00	-1,68	0,03	12.416.688,38	0,97
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	Artigo 7º III, Alínea a	0,34	2,90	-0,00	-0,71	-0,04	42.485.241,71	3,32
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	Artigo 7º VII, Alínea a	0,35	0,02	0,00	-0,85	-0,11	14.240.762,27	1,11
BR HOTÉIS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,41	0,02	0,00	-0,78	-0,12	13.112.962,05	1,02
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	Artigo 8º III	0,52	0,97	0,00	-0,71	-0,17	35.881.767,78	2,80
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,53	0,01	0,66	0,55	68.630.995,11	5,36
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,70	0,50	0,01	0,48	0,53	41.024.460,64	3,20
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	1,37	0,12	0,00	-0,44	-0,41	5.853.204,34	0,46
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,61	2,74	0,01	0,38	0,81	9.428.870,04	0,74
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,93	2,83	0,42	0,41	0,98	232.297.847,94	18,14
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,20	3,75	0,08	0,43	1,14	34.515.895,23	2,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	3,09	0,29	0,71	1,77	139.241.864,49	10,87
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	3,44	4,65	0,47	0,46	1,79	156.460.122,82	12,22
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	Artigo 7º III, Alínea a	3,60	5,80	0,01	0,12	0,62	15.438.692,32	1,21
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,41	7,93	-0,01	-0,16	-0,68	10.242.154,59	0,80
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	8,28	0,04	0,00	-0,16	-1,15	16.767.773,73	1,31
ILLUMINATI FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	8,31	0,55	0,00	-0,32	-2,48	26.825.190,72	2,10
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,09	28,04	1,05	0,24	4,36	49.491.212,55	3,87
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	18,03	26,94	0,91	0,51	9,40	43.954.548,92	3,43
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	18,35	30,76	1,45	0,40	7,54	61.573.823,45	4,81
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	20,59	25,66	0,73	0,44	9,23	37.022.427,64	2,89
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	21,62	25,69	1,11	0,46	10,05	57.071.379,25	4,46
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,09	27,09	0,74	0,46	10,35	35.424.971,05	2,77
TMJ IMA-B FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	36,84	14,94	0,11	0,01	0,56	19.579.191,90	1,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FII INFRA REAL ESTATE - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	43,06	1,49	0,00	-0,29	-12,20	1.056.210,55	0,08
GBX PRIME I FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	43,32	0,15	0,00	-0,01	-0,21	11.261.985,98	0,88
BBIF MASTER FIDC LP	Artigo 7º VII, Alínea a	47,62	0,55	-0,00	0,32	15,47	132.495,83	0,01