



PATO BRANCO
3º TRIMESTRE 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 15.10.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **78,32%**

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	6,00	-0,66	-0,35	435.326,78	1,11	4.983.832.924,90	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	1,21	3.848.969,78	9,78	17.747.142.317,32	0,02
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,16	0,17	1,61	20,42	0,00	7.070.754.781,93	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,88	-0,98	-0,68	2.801.847,38	7,12	3.209.755.140,80	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	-0,61	-0,30	411.021,79	1,04	11.234.342.142,99	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,98	-0,15	1,18	6.580.701,87	16,71	4.406.252.863,92	0,15
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	0,10	6.233.402,60	15,83	10.452.752.168,75	0,06
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	-0,09	5.400.373,20	13,72	13.535.810.678,86	0,04
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	8,92	-1,16	-0,86	1.271.487,94	3,23	475.443.951,71	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,99	-0,54	0,29	26.983.151,76	68,54		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	-0,00	0,18	40.981,52	0,10	1.878.414.583,86	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	-0,23	0,20	3.112.922,63	7,91	4.773.930.449,92	0,07
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,93	-0,59	-0,01	697.595,73	1,77	547.986.362,75	0,13
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,66	-0,28	0,16	3.851.499,88	9,78		

Renda Fixa			5,36	-0,51	0,27	30.834.651,64	78,32		
-------------------	--	--	-------------	--------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,68%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,49	-5,04	-0,39	1.890.373,40	4,80	900.328.465,10	0,21
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,83	-4,71	-0,49	559.665,66	1,42	634.870.630,59	0,09
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,30	-4,97	-0,41	2.450.039,06	6,22		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	36,51	-5,09	-3,96	1.429.321,55	3,63	418.612.050,90	0,34
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	45,69	-4,08	1,22	670.462,49	1,70	383.801.473,81	0,17
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	46,97	-5,18	-0,85	1.718.738,14	4,37	496.563.544,01	0,35
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,48	-4,96	2,00	477.369,61	1,21	3.159.975.144,49	0,02
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	45,72	-5,40	-1,39	584.855,87	1,49	1.166.738.485,17	0,05
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,88	-4,98	-1,46	4.880.747,66	12,40		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	7,75	-0,91	0,35	834.939,83	2,12	5.019.584.079,54	0,02
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,41	-0,57	0,44	369.690,75	0,94	55.327.907,23	0,67
Sub-total Artigo 8º III			7,73	-0,83	0,47	1.204.630,58	3,06		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,94	-4,48	-0,93	8.535.417,30	21,68		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	---------------------	--------------	--	--

Total						39.370.068,94	100,00		
--------------	--	--	--	--	--	----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	26.983.151,76	68,54	0,00	65,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	3.851.499,88	9,78	0,00	5,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	30.834.651,64	78,32				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	2.450.039,06	6,22	0,00	15,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	4.880.747,66	12,40	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.204.630,58	3,06	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	8.535.417,30	21,68				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

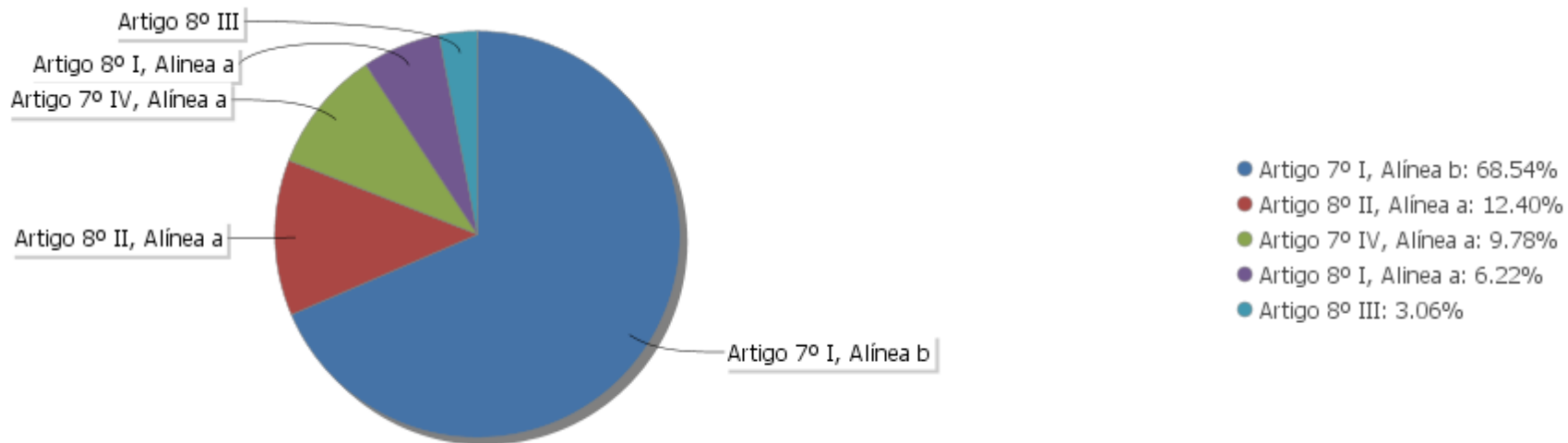
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,54 -342,31	0,29 55,77	0,29 55,77	3,78 302,12	6,00 169,26	-148.043,01	66.098,99
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,28 -177,84	0,16 30,55	0,16 30,55	1,26 101,11	3,61 102,02	-10.428,53	6.212,63
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,97 -0,17	-0,41 0,06	-0,41 0,06	29,97 0,41	-8,55 1,14	-128.091,27	-36.230,80
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,98 -0,18	-1,46 -0,99	-1,46 -0,99	23,63 -5,93	-6,90 2,78	-250.466,87	-109.322,79
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,83 3,97	0,47 0,95	0,47 0,95	5,90 -23,66	3,18 12,86	-7.998,99	2.888,57
						-545.028,67	-70.353,40

Análise de Liquidez

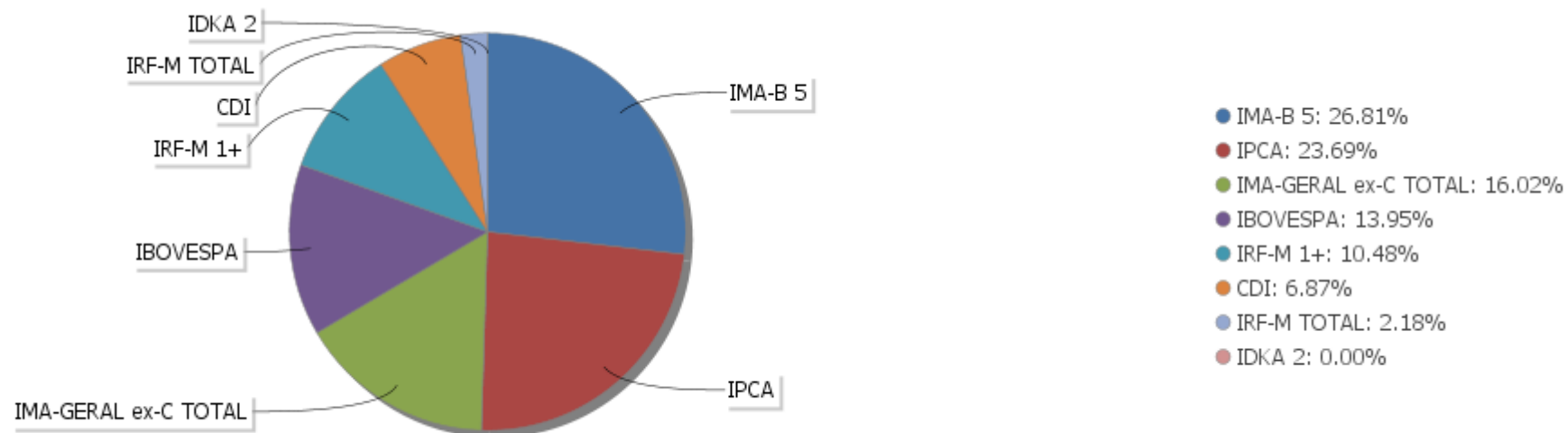
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	38.892.699,33	98,79	38.892.699,33	98,79
de 31 a 364 dias	477.369,61	1,21	39.370.068,94	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	39.370.068,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

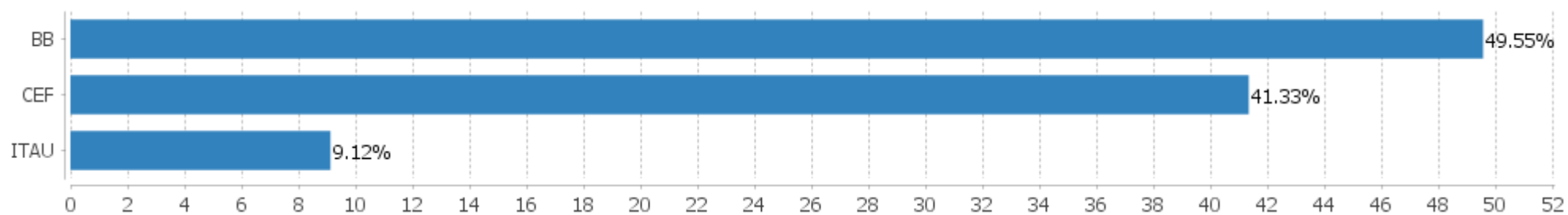


Alocação Por Estratégia



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	0,47	-0,63	-5,97	2,01	2,51	1,89	2,32	-0,99	-1,37				-0,05
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12				5,76
p.p. indexador	-0,25	-1,29	-6,54	1,87	2,44	1,15	1,43	-1,71	-2,49				-5,81
2019	1,43	0,31	0,54	0,84	1,61	1,98	1,00	0,11	1,77	1,74	-0,36	1,55	13,24
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	0,60	-0,58	-0,66	-0,22	0,97	1,53	0,28	-0,51	1,32	1,11	-1,33	-0,09	2,65

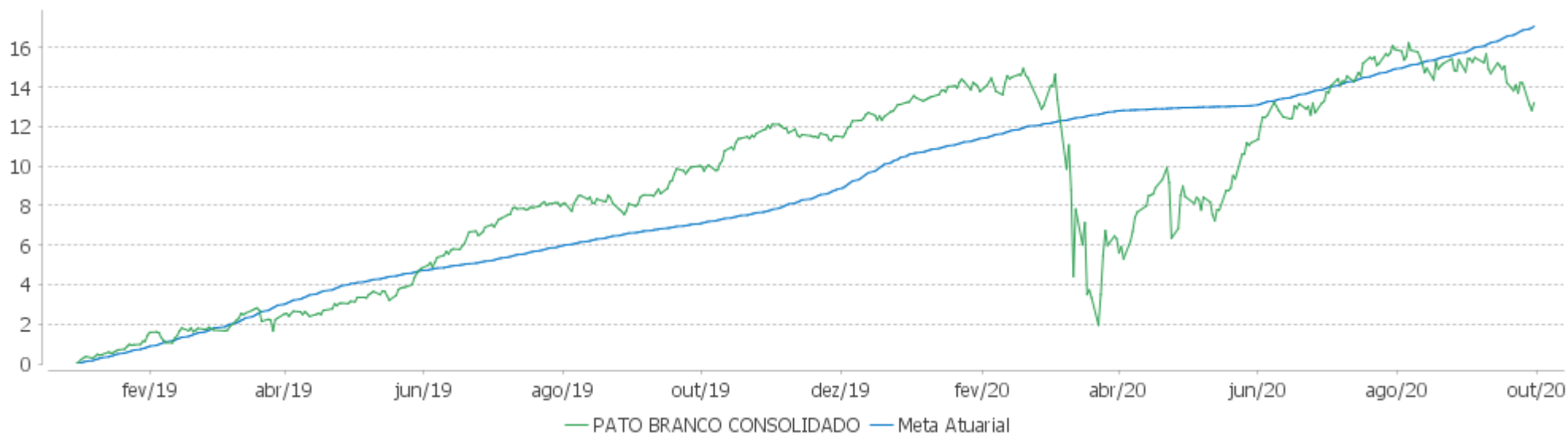
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

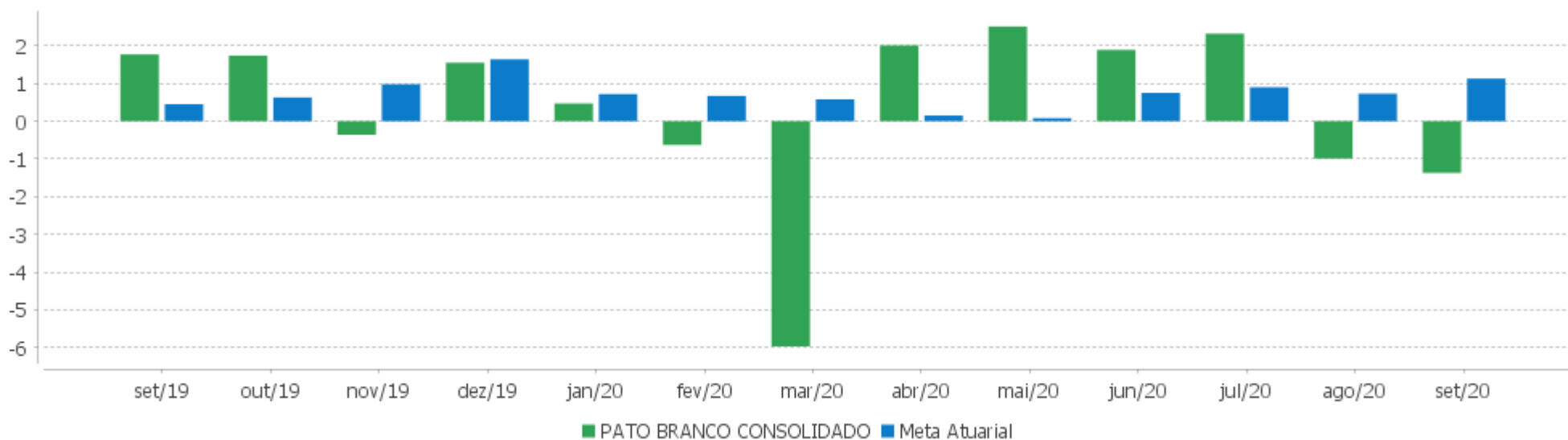
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	10	47,62	03 meses	-0,08	2,75	-2,83	5,55
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	52,38	06 meses	6,47	3,74	2,74	7,44
			12 meses	2,90	9,24	-6,34	9,97
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,51	2020-05	Desde 31/12/2018	13,19	16,96	-3,78	7,72
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,98 -0,06	-0,68 -0,08	-0,68 -0,08	3,70 -0,20	7,33 -0,28	29,68 -0,32	35,97 -0,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	1,21 -0,09	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,11 0,10	1,61 -0,38	1,61 -0,38	5,24 -0,17	7,28 -0,72	20,27 -1,61	29,41 -2,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	0,10 -0,15	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,16 -0,25	-0,86 -0,27	-0,86 -0,27	3,24 -0,66	6,83 -0,78		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	-0,09 -1,34	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,03	1,18 -0,11	1,18 -0,11	4,93 -0,17	6,95 -0,29	23,16 -0,59	30,94 -0,89
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,66 -0,10	-0,35 -0,11	-0,35 -0,11	2,90 -0,25	6,21 -0,35	23,82 -0,67	30,66 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,61 -0,05	-0,30 -0,07	-0,30 -0,07	3,01 -0,13	6,31 -0,25	24,12 -0,38	30,74 -0,90
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	-0,00 -0,19	0,18 34,55	0,18 34,55	0,66 53,10	2,40 67,81	7,66 76,30	13,60 78,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,23 -0,87	0,20 -1,05	0,20 -1,05	1,32 0,51	3,69 0,56	17,87 11,75	25,30 14,38
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,59 -1,23	-0,01 -1,25	-0,01 -1,25				
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-4,71 0,09	-0,49 -0,01	-0,49 -0,01	29,15 -0,41	-9,67 0,01	18,59 -0,64	26,05 -1,29
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-5,04 -0,25	-0,39 0,09	-0,39 0,09	30,27 0,71	-8,20 1,48	24,95 5,72	26,70 -0,63
BB AÇÕES ENERGIA FI % do CDI	-5,09 -3.240,28	-3,96 -773,99	-3,96 -773,99	15,11 1.208,29	-5,46 -154,05	66,13 658,80	63,41 365,32
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	-5,18 -0,39	-0,85 -0,38	-0,85 -0,38	30,77 1,21	-5,21 4,47	60,72 41,49	44,82 17,48
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-4,96	2,00	2,00	30,39	-10,53	31,29	43,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-4,08 0,71	1,22 1,70	1,22 1,70	41,11 11,55	-0,91 8,77	50,92 31,69	24,95 -2,39
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-5,40 -0,60	-1,39 -0,92	-1,39 -0,92	22,19 -7,36	-6,82 2,87		
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	-0,57 -361,33	0,44 84,96	0,44 84,96	1,61 128,92			
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,91 -579,32	0,35 67,67	0,35 67,67	5,77 461,09	3,05 86,11	22,65 225,65	30,42 175,24
CDI	0,16	0,51	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	3,22	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6%	1,13	2,78	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,15	0,51	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF-M 1+	-0,91	-0,59	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IRF-M TOTAL	-0,56	-0,24	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IMA-B 5	-0,12	1,30	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA-B 5+	-2,60	0,75	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA-B TOTAL	-1,51	0,96	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA-C TOTAL	2,95	9,60	9,60	18,32	19,95	48,39	67,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	0,25	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	0,53	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IDKA 2	0,02	1,99	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26
IDKA 20	-4,30	0,58	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43
CDI	0,16	0,51	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IBRX 100	-4,58	-0,04	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47
IBRX 50	-4,62	-0,37	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57
SMALL CAP	-5,44	2,27	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IFIX	0,46	-0,41	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
Índice Consumo - ICON	-3,96	1,83	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-3,31	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,64	1,24	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92
INPC	0,87	1,68	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17
IGPM	4,34	9,59	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14
SELIC	0,16	0,51	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

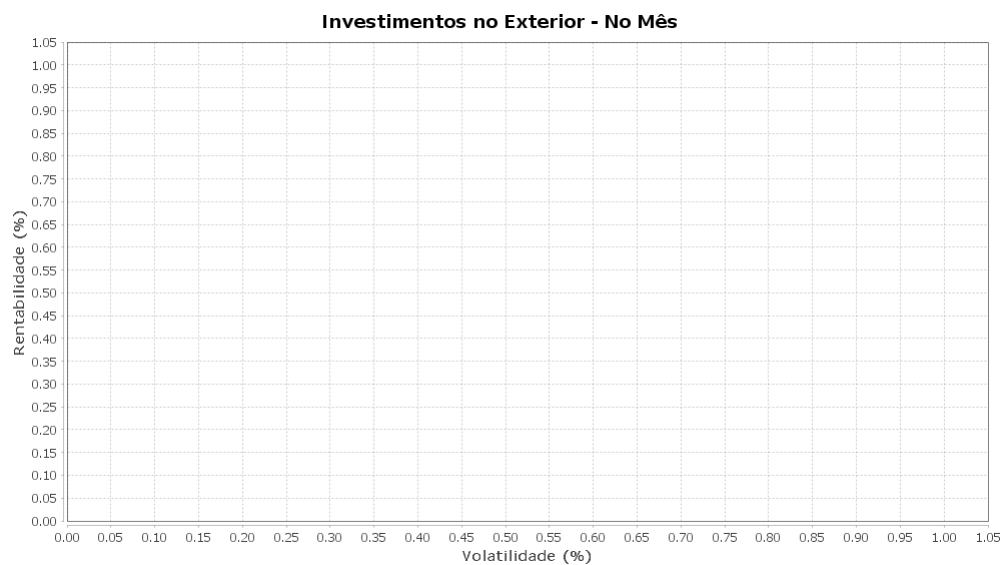
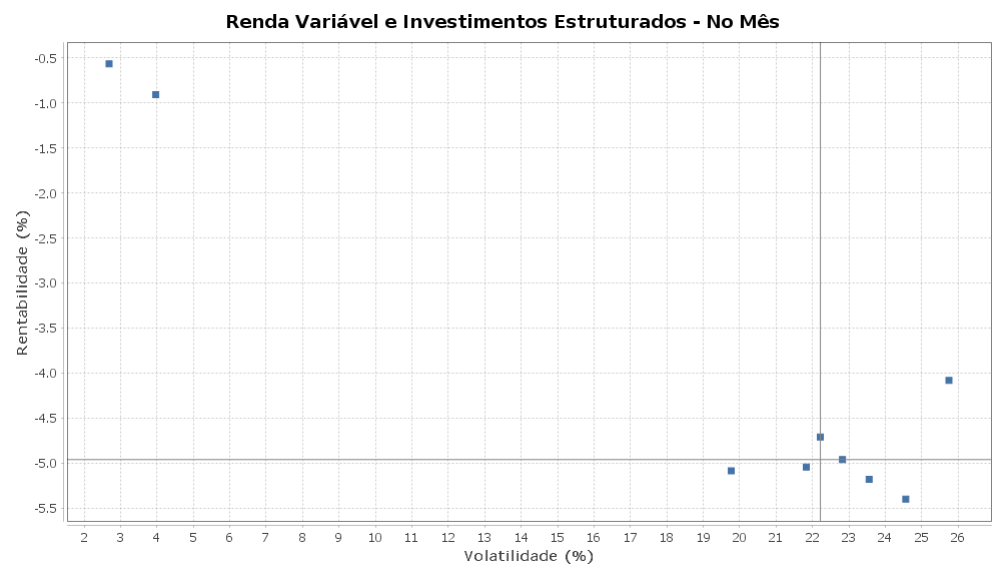
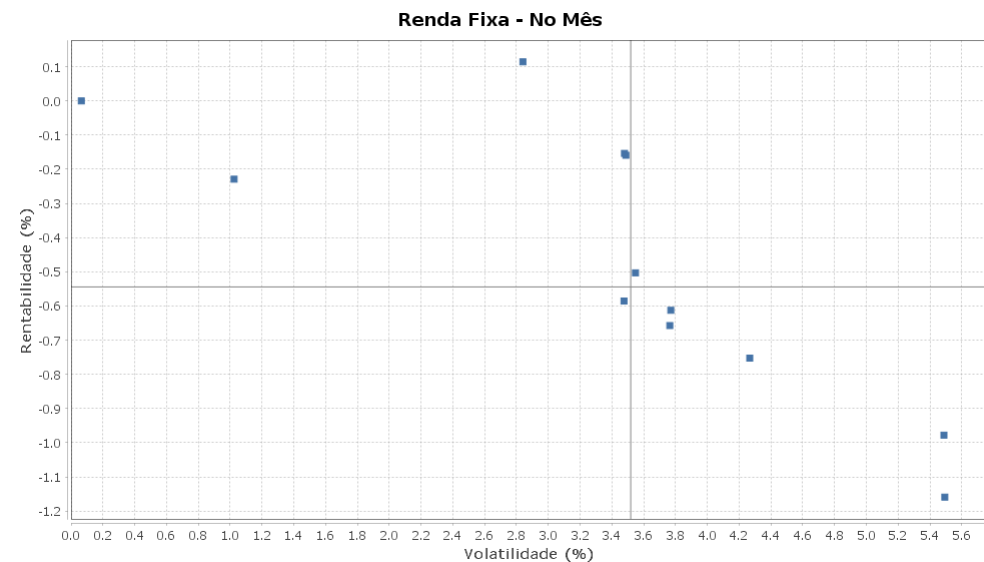
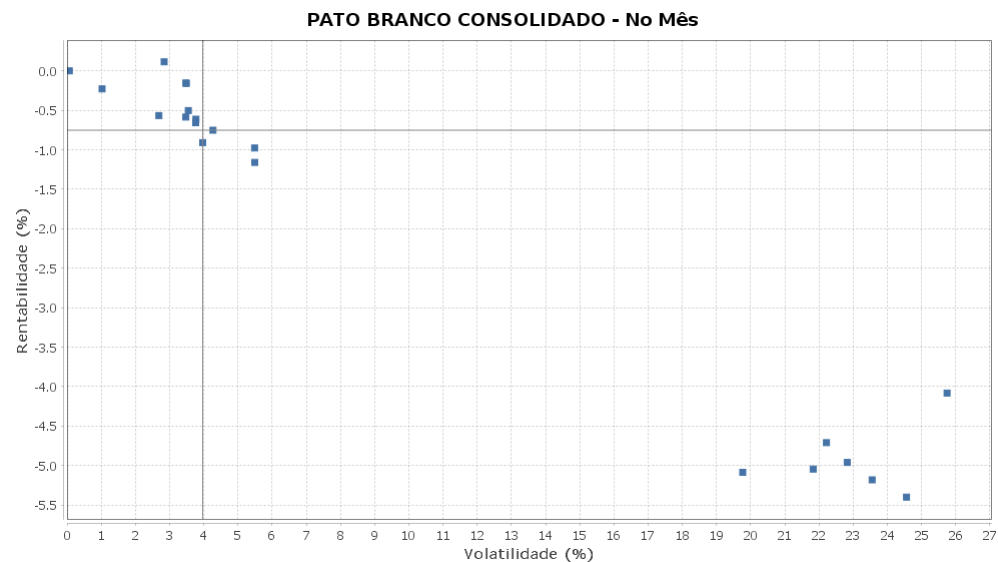
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
81	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	34.779,32	0,00	13.702,51255700	2,5381710000
86	01/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,48620500	2,1060352580
85	07/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	45.000,00	0,00	21.363,38032000	2,1064082240
87	10/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.534,40	7.848,55096800	2,1066818660
80	16/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	400.000,00	0,00	128.821,82138500	3,1050640000
88	16/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,48548200	2,1070597270
77	17/07/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	500.000,00	0,00	153.418,37385300	3,2590620500
78	17/07/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	75.000,00	0,00	27.266,24875200	2,7506534060
79	17/07/2020	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	50.000,00	0,00	49.077,77491800	1,0187910940
76	17/07/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	398.207,10	0,00	20.046,50939900	19,8641614890
83	17/07/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	200.000,00	0,00	195,62913300	1.022,3426140000
82	20/07/2020	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	75.000,00	0,00	31.662,64340000	2,3687220000
89	20/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.397,09	1.137,54926300	2,1072406070
84	29/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	637.906,98	426.811,82844300	1,4945860000
90	31/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.358,32	2.067,44218700	2,1080734580
104	03/08/2020	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	19.685,48	0,00	19.242,37591900	1,0230275140
99	04/08/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	34.196,88	0,00	1.714,81872400	19,9419795830
95	10/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.648,34	8.369,71160800	2,1085959500
102	14/08/2020	BB PREV IRF-M 1+	252.538,41	0,00	215.144,81459700	1,1738066310
101	14/08/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	500.000,00	0,00	335.356,84748600	1,4909491300
93	14/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	250.000,00	0,00	98.514,36398500	2,5377010000
92	14/08/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	200.000,00	0,00	195,05267300	1.025,3640530000
96	14/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,48420200	2,1088780160
100	17/08/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	300.000,00	0,00	112.781,51241000	2,6600104360
94	17/08/2020	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	200.000,00	0,00	117.210,75900900	1,7063280000
97	20/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.498,74	1.184,71561800	2,1091475140
91	26/08/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	631.536,38	35.100,33253635	17,9923190000
103	31/08/2020	BB PREV IRF-M 1+	53.009,62	0,00	45.117,49812700	1,1749237480

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
98	31/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.296,82	2.036,73717500	2,1096585520
114	02/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	50.000,00	0,00	23.698,75380200	2,1098155800
115	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.242,11	8.644,93009700	2,1101512440
109	22/09/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	384.727,50	0,00	19.227,66109700	20,0090639240
108	22/09/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	500.000,00	0,00	159.739,25442000	3,1301010000
106	22/09/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	300.000,00	0,00	293,18595000	1.023,2413900000
116	22/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,48337900	2,1100478520
111	23/09/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	200.000,00	0,00	64.502,54619000	3,1006527930
113	23/09/2020	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	300.000,00	0,00	294.415,14114700	1,0189693330
112	28/09/2020	BB PREV IRF-M 1+	0,00	653.790,49	564.061,69942000	1,1590761980
107	28/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	0,00	25.464,24	10.145,17897500	2,5099840000
110	30/09/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	21.179,01	0,00	1.060,06796000	19,9789171970
117	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.458,09	2.113,18714200	2,1096522460

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	40.981,52	0,10
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,02	0,41	0,03	-0,38	-0,23	3.112.922,63	7,91
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	2,69	0,63	0,00	-0,27	-0,57	369.690,75	0,94
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,94	0,00	-0,02	0,11	20,42	0,00
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	3,48	1,25	0,02	-0,21	-0,59	697.595,73	1,77
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,03	0,12	-0,09	-0,15	6.580.701,87	16,71
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,07	-0,09	-0,16	3.848.969,78	9,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,15	-0,19	-0,50	5.400.373,20	13,72
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,76	1,34	0,01	-0,22	-0,66	435.326,78	1,11
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,77	1,39	0,01	-0,20	-0,61	411.021,79	1,04
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,97	1,62	0,03	-0,27	-0,91	834.939,83	2,12
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,19	-0,21	-0,75	6.233.402,60	15,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,49	1,97	0,11	-0,21	-0,98	2.801.847,38	7,12
BB PREV IRF-M 1+	Artigo 7º I, Alínea b	5,49	1,96	0,05	-0,24	-1,16	1.271.487,94	3,23
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	19,77	12,39	0,40	-0,27	-5,09	1.429.321,55	3,63
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,83	11,24	0,50	-0,24	-5,04	1.890.373,40	4,80
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,22	11,46	0,15	-0,22	-4,71	559.665,66	1,42
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,82	12,64	0,14	-0,22	-4,96	477.369,61	1,21
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	23,55	11,87	0,48	-0,23	-5,18	1.718.738,14	4,37
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	24,56	13,57	0,08	-0,23	-5,40	584.855,87	1,49
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	25,75	11,61	0,17	-0,16	-4,08	670.462,49	1,70