



PATO BRANCO
4º TRIMESTRE 2019



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 03.03.2020.

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 **86,91%**

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	2,12	0,60	1,81	930.484,45	3,14	5.286.422.243,27	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	1,21	2,52	2.286.293,01	7,72	9.819.854.122,58	0,02
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,50	1,17	2,62	19,53	0,00	7.688.780.054,14	0,00
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,33	2,72	3,10	267.187,41	0,90	2.584.536.131,14	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	2,99	0,70	2,07	1.428.920,95	4,83	2.077.044.204,00	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	2,16	0,61	1,81	532.649,23	1,80	14.821.342.261,54	0,00
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,98	1,19	2,54	4.966.400,62	16,77	4.389.106.279,05	0,11
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,37	0,96	1,81	5.552.437,06	18,75	9.800.245.404,11	0,06
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,76	0,59	1,80	5.161.986,36	17,43	9.818.666.120,10	0,05
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1+ FI	3,02	0,69	2,05	1.551.508,17	5,24	76.107.727,21	2,04
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,13	0,91	2,08	22.677.886,79	76,58		

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 PREVID RF FLUXO FIC	0,04		0,97	0,00	0,00	1.433.610.134,03	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,01	0,34	1,19	3.057.728,93	10,33	5.156.074.278,85	0,06
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,26	0,34	1,18	3.057.728,93	10,33		
Renda Fixa			2,06	0,85	1,99	25.735.615,72	86,91		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,09%

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 PREV ACOES GV	17,33	7,56	11,66	1.314.728,22	4,44	745.475.334,96	0,18
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	17,67	6,84	10,36	294.657,66	1,00	543.162.917,23	0,05
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			17,42	7,39	11,30	1.609.385,88	5,43		

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	16,47	11,76	12,29	723.594,99	2,44	430.871.641,53	0,17
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA	16,94	9,36	14,00	721.122,24	2,44	484.754.191,32	0,15
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	16,35	8,13	12,81	601.893,34	2,03	4.621.308.299,25	0,01
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,32	9,50	14,12	2.046.610,57	6,91		

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 ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,69	2,09	3,77	221.456,78	0,75	6.549.214.461,54	0,00
Sub-total Artigo 8º III			3,69	2,09	3,77	221.456,78	0,75		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,24	8,02	12,09	3.877.453,23	13,09		
Total						29.613.068,95	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	22.677.886,79	76,58	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	3.057.728,93	10,33	0,00	20,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	25.735.615,72	86,91				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	1.609.385,88	5,43	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	2.046.610,57	6,91	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	221.456,78	0,75	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	3.877.453,23	13,09				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

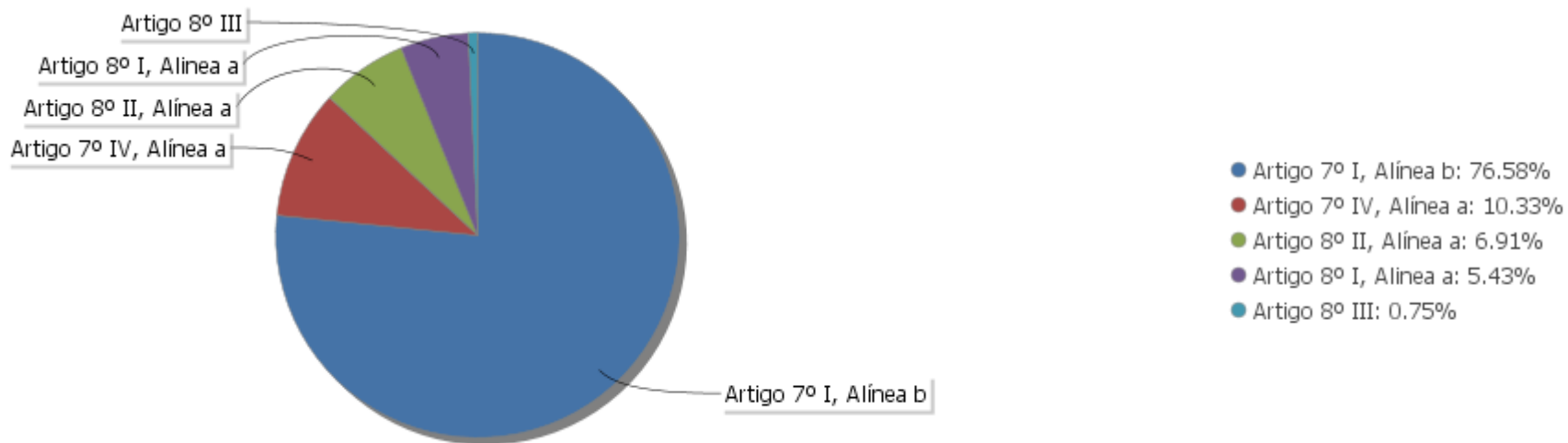
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,91 242,00	2,08 168,20	2,08 168,20	4,98 178,02	12,34 207,11	199.328,92	420.910,64
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,34 91,46	1,18 95,44	1,18 95,44	2,68 95,78	5,59 93,76	6.707,00	20.687,96
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,39 0,54	11,30 0,90	11,30 0,90	15,74 1,21		76.133,54	106.369,49
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,50 2,65	14,12 3,71	14,12 3,71			128.116,03	178.015,89
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,09 -4,76	3,77 -6,64	3,77 -6,64	7,38 -7,16		4.531,95	8.036,28
						414.817,44	734.020,26

Análise de Liquidez

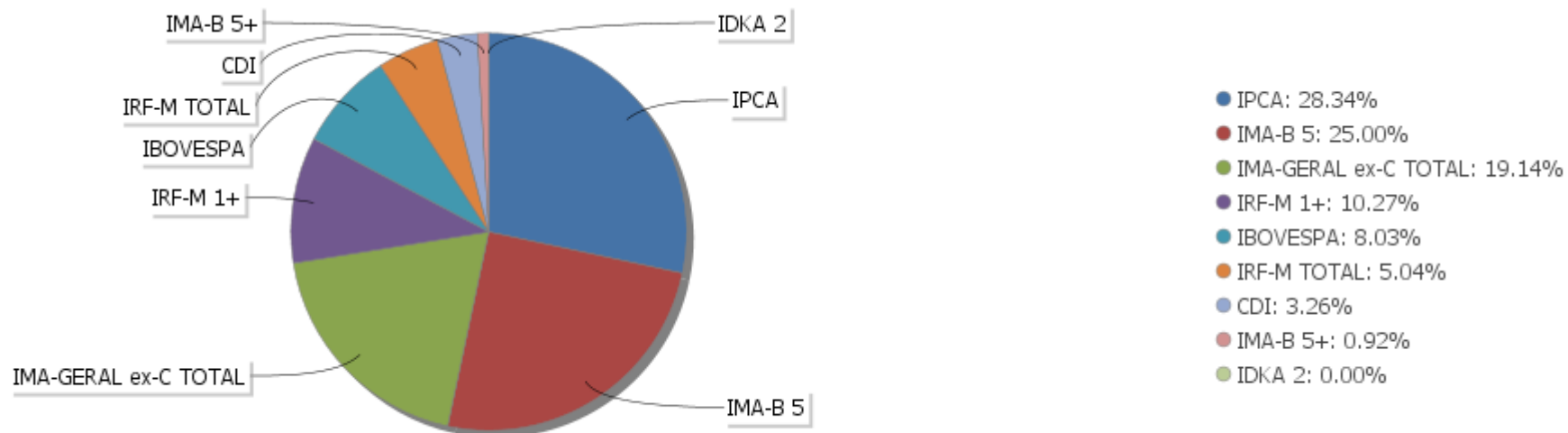
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	29.011.175,61	97,97	29.011.175,61	97,97
de 31 a 364 dias	601.893,34	2,03	29.613.068,95	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	29.613.068,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

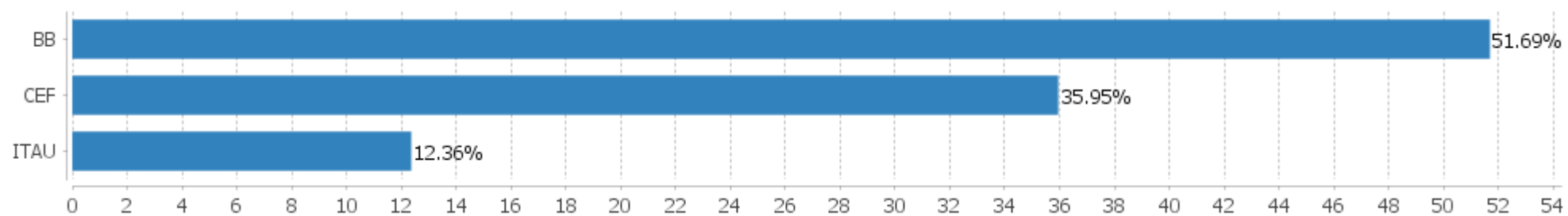


Alocação Por Estratégia



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
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

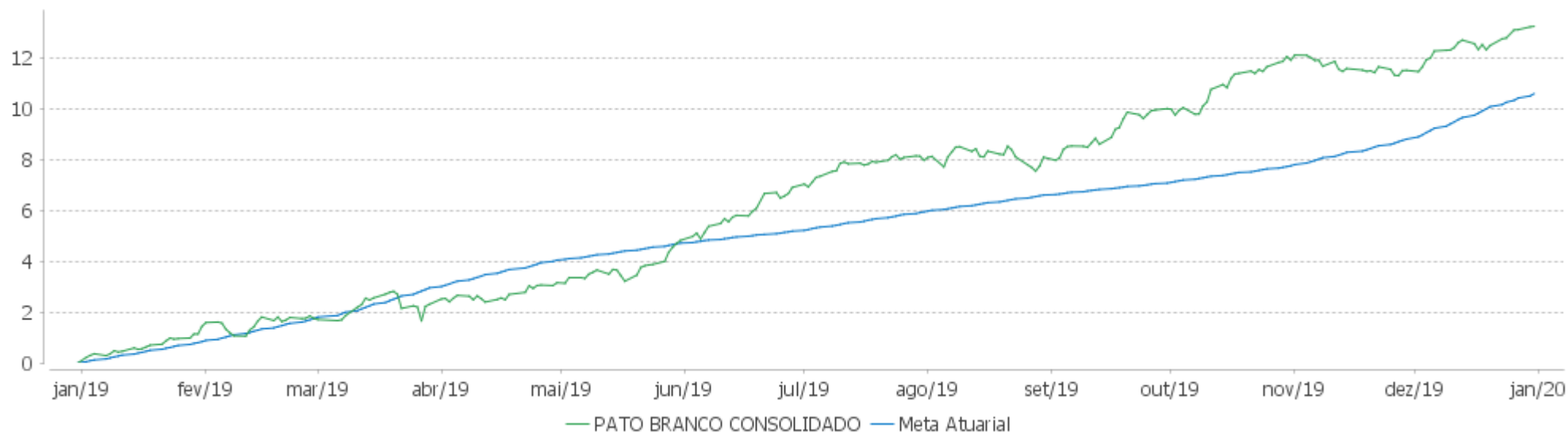
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

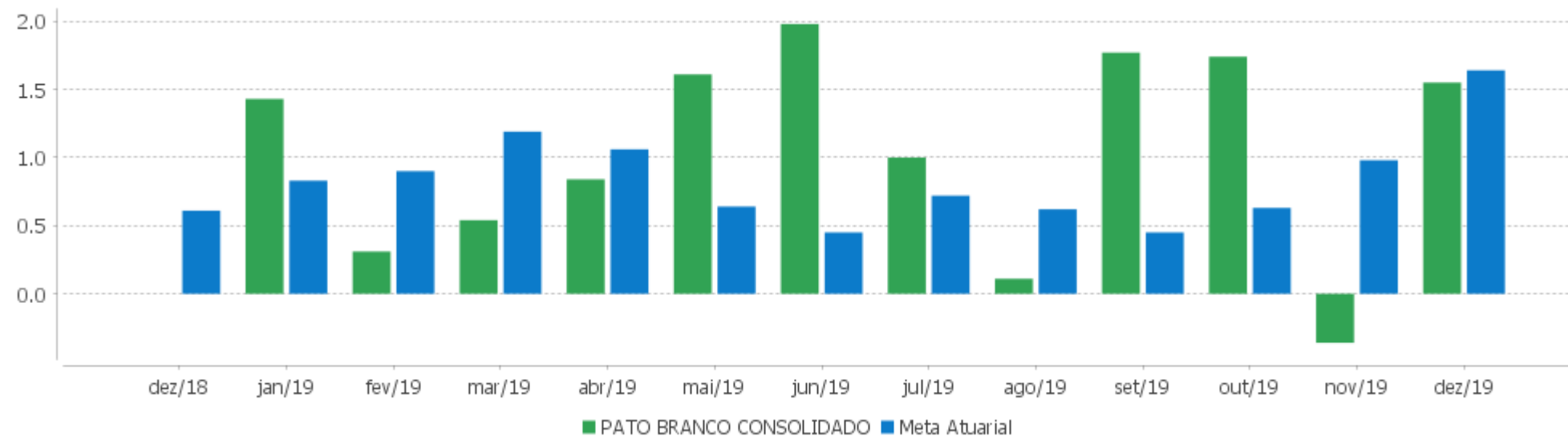
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	50,00	03 meses	2,95	3,28	-0,34	2,41
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	50,00	06 meses	5,94	5,15	0,79	2,49
			12 meses	13,24	10,59	2,65	2,49
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,98	2019-06	Desde 31/12/2018	13,24	10,59	2,65	2,49
Menor rentabilidade da Carteira	-0,36	2019-11					

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
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,28 76,00	0,97 78,01	0,97 78,01	2,23 79,65	4,82 80,86	10,36 81,17	20,14 84,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,34 -0,81	1,19 -0,57	1,19 -0,57	3,28 1,25	11,91 7,61	21,11 12,90	36,70 25,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,70 -0,02	2,07 -0,03	2,07 -0,03	5,34 -0,10	13,89 -0,35	27,90 -0,35	48,55 -1,08
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	1,21 -0,03	2,52 -0,10	2,52 -0,10	5,31 -0,17	12,85 -0,30	23,77 -0,55	39,09 -0,86
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,05	2,62 0,16	2,62 0,16	5,15 -0,10	11,20 -0,62	21,46 -1,27	36,52 -2,92
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,96 0,05	1,81 -0,09	1,81 -0,09	4,48 -0,06	13,07 0,44	24,27 0,61	39,50 -0,09
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1+ FI Var. IRF-M 1+ p.p.	0,69 -0,03	2,05 -0,05	2,05 -0,05	5,27 -0,17			
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	0,59 -0,56	1,80 0,03	1,80 0,03	4,97 2,94	16,43 12,13	25,53 17,32	39,61 28,21
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,19 -0,04	2,54 -0,08	2,54 -0,08	5,34 -0,13	12,89 -0,27	23,78 -0,53	39,16 -0,80
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,60 -0,02	1,81 -0,05	1,81 -0,05	4,61 -0,11	11,79 -0,24	23,56 -0,49	41,98 -0,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,61 -0,01	1,81 -0,05	1,81 -0,05	4,59 -0,13	11,68 -0,35	23,64 -0,41	41,94 -0,97
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	2,72 0,12	3,10 0,08	3,10 0,08	7,66 0,03	30,05 -0,32	49,74 -0,72	67,95 -1,68
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	6,84 -0,01	10,36 -0,05	10,36 -0,05	14,33 -0,21	31,00 -0,58	50,03 -1,34	88,84 -3,17
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	7,56 0,71	11,66 1,25	11,66 1,25	16,39 1,85	33,90 2,32	52,17 0,81	96,00 3,98
BB AÇÕES ENERGIA FI % do CDI	11,76 3.137,71	12,29 991,33	12,29 991,33	17,72 633,11	49,91 837,41	104,03 815,06	118,91 496,38
FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	9,36 2,51	14,00 3,60	14,00 3,60	24,77 10,23	54,32 22,73	72,82 21,45	113,86 21,84
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	8,13	12,81	12,81	22,94	45,27	77,92	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	2,09 557,56	3,77 303,81	3,77 303,81	7,38 263,46	18,08 303,39	29,14 228,33	43,79 182,81
CDI	0,37	1,24	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
IBOVESPA	6,85	10,41	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
INPC + 6%	1,71	3,33	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25
IPCA + 6%	1,64	3,28	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56

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	0,42	1,38	1,38	3,33	6,76	14,21	26,90
IRF-M 1+	0,72	2,10	2,10	5,44	14,24	28,25	49,63
IRF-M TOTAL	0,62	1,86	1,86	4,72	12,03	24,05	42,91
IMA-B 5	1,24	2,62	2,62	5,47	13,15	24,32	39,95
IMA-B 5+	2,60	3,02	3,02	7,64	30,37	50,45	69,64
IMA-B TOTAL	2,01	2,85	2,85	6,72	22,95	39,01	56,79
IMA-C TOTAL	0,40	1,84	1,84	5,35	19,41	41,36	56,88
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,91	1,90	1,90	4,54	12,63	23,66	39,60
IMA-GERAL TOTAL	0,90	1,90	1,90	4,56	12,82	24,14	40,06
IDKA 2	1,20	2,46	2,46	5,25	11,82	22,73	39,44
IDKA 20	3,94	3,32	3,32	8,71	44,26	73,70	94,85
CDI	0,37	1,24	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
Renda Variável							
IBOVESPA	6,85	10,41	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
IBRX 100	7,27	10,70	10,70	15,40	33,39	53,96	96,37
IBRX 50	6,56	9,81	9,81	13,17	29,15	47,91	87,58
SMALL CAP	12,65	21,15	21,15	32,65	58,20	71,06	155,48
IFIX	10,63	19,12	19,12	21,76	35,98	43,62	71,49
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	9,99	14,28	14,28	22,33	45,16	68,32	110,90
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,15	1,77	1,77	2,03	4,31	8,21	11,40
INPC	1,22	1,81	1,81	1,98	4,48	8,07	10,30
IGPM	2,09	3,09	3,09	2,80	7,32	15,42	14,81
SELIC	0,37	1,24	1,24	2,80	5,96	12,77	23,98
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	1,48	2,79	2,79	4,12	8,50	17,02	25,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	1,56	3,04	3,04	4,63	9,54	19,28	28,86
IPCA + 5,5%	1,60	3,16	3,16	4,89	10,07	20,42	30,70
IPCA + 5,89%	1,63	3,26	3,26	5,09	10,47	21,31	32,15
IPCA + 6%	1,64	3,28	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56
INPC + 4%	1,55	2,83	2,83	4,06	8,68	16,87	24,00
INPC + 6%	1,71	3,33	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
01/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	27.016,75	0,00	13.111,74976195	2,0604992080
01/10/2019	BB PREVID RF IRF-M1	10.139,52	0,00	3.899,10569000	2,6004732380
01/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	10.000,86	4.853,61021300	2,0604992080
02/10/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	31.351,32	0,00	1.809,70853028	17,3239610000
10/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	12.596,19	6.105,99612733	2,0629213870
15/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	26.175,78	12.682,27100508	2,0639663030
15/10/2019	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	34.022,28	13.042,38443400	2,6085928120
15/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	33.833,02	15.189,57867600	2,2273836470
15/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	95,20	0,00	46,12478400	2,0639663030
16/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	7,31	3,54112000	2,0643186970
16/10/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	33.826,56	0,00	1.791,83209600	18,8781973900
16/10/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	34.019,96	0,00	1.802,07671800	18,8781973900
17/10/2019	FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	500.000,00	0,00	353.362,88389300	1,4149760000
17/10/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	500.000,00	0,00	168.958,87540900	2,9593000000
17/10/2019	BB AÇÕES ENERGIA FI	138.266,60	0,00	9.626,37978300	14,3633020000
17/10/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	500.000,00	0,00	26.434,46245700	18,9147027600
17/10/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	8,80	0,00	0,46524600	18,9147027600
21/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	2.037,31	986,42550300	2,0653460330
21/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	50.977,70	24.682,40148900	2,0653460330
23/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	665,00	0,00	321,87203900	2,0660384220
25/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.852,58	896,38255300	2,0667292040
29/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	44.110,76	0,00	21.336,24738200	2,0674094750
30/10/2019	BB PREV RF IDKA2	0,00	387.262,57	146.176,89996700	2,6492733810
31/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	9.725,11	4.702,50297900	2,0680709920
31/10/2019	BB PREV RF IDKA2	10.643,85	0,00	4.026,92523200	2,6431705050
31/10/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	53.472,12	0,00	25.856,03695700	2,0680709920
01/11/2019	BB AÇÕES ENERGIA FI	303,22	0,00	20,48133000	14,8047020000
05/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	270,13	130,55994000	2,0690113720

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

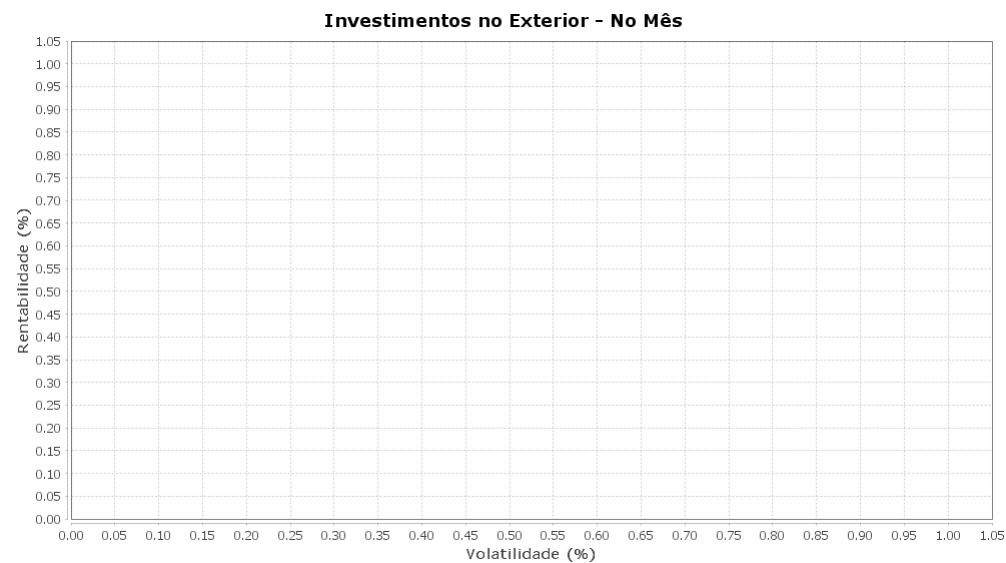
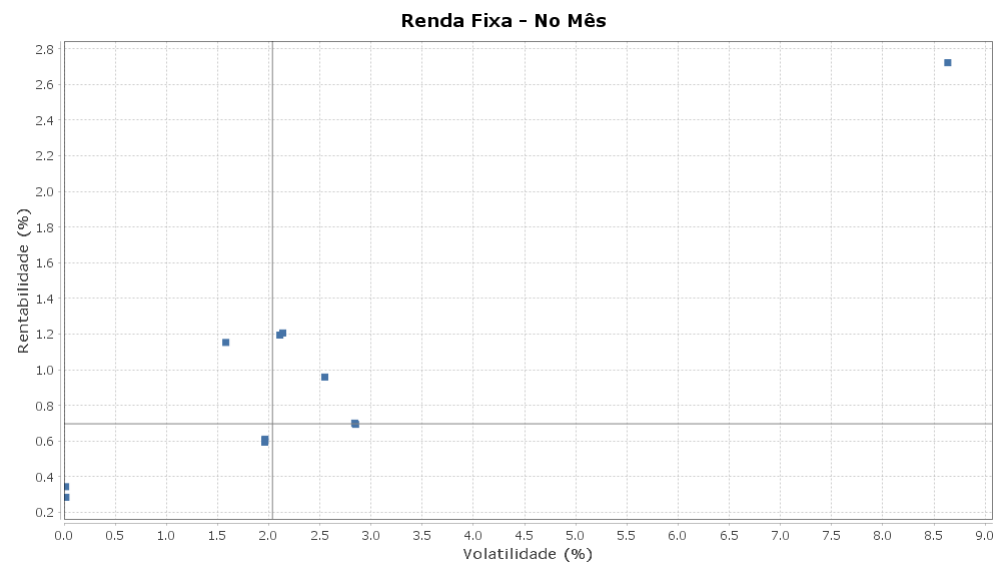
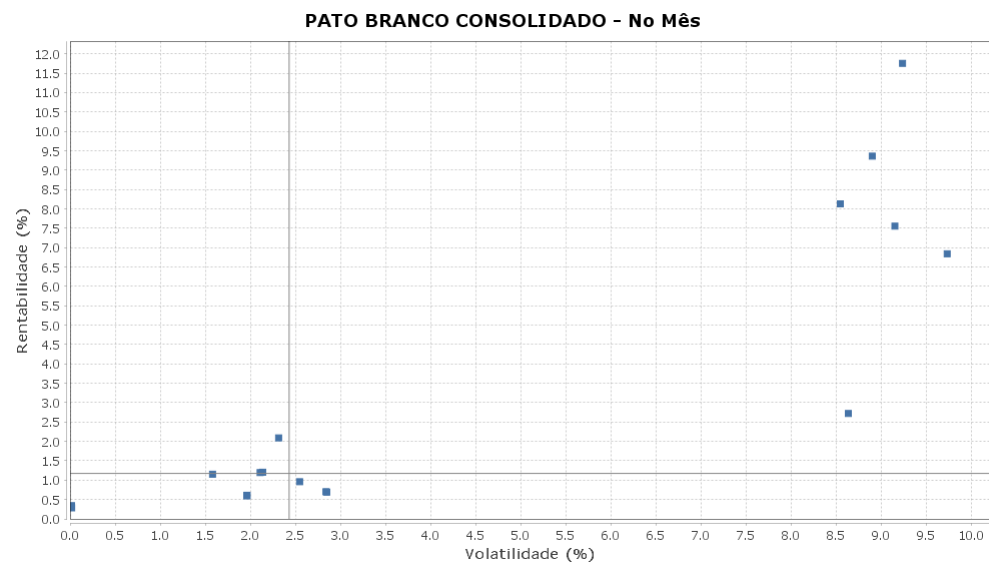
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
06/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	790,71	382,11032800	2,0693238100
06/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	166,71	0,00	80,56254800	2,0693238100
06/11/2019	BB AÇÕES ENERGIA FI	31.508,91	0,00	2.129,39837100	14,7970950000
11/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	11.651,07	5.627,93671800	2,0702205060
14/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	200,00	96,56508400	2,0711419960
20/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	10.174,73	4.910,45612700	2,0720539470
20/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	53.456,45	25.798,77327900	2,0720539470
21/11/2019	BB PREV ACOES GV	158.159,63	0,00	55.736,44005800	2,8376342270
21/11/2019	BB PREV ALOC FIC	500.000,00	0,00	346.770,41312400	1,4418761840
21/11/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	500.000,00	0,00	168.781,38489800	2,9624120000
21/11/2019	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	500.000,00	0,00	354.732,45014400	1,4095130000
26/11/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	282.173,23	128.555,65328800	2,1949500000
27/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	504,00	0,00	243,05676300	2,0735896930
28/11/2019	BB PREV RF IDKA2	0,00	137.474,58	51.871,86907900	2,6502723430
29/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	9.155,48	4.414,04536000	2,0741698950
29/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	58.470,28	0,00	28.189,72550900	2,0741698950
29/11/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	93,20	42,37482000	2,1994190000
29/11/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	303,22	0,00	137,86368100	2,1994190000
02/12/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.200,00	578,46012400	2,0744731580
05/12/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	12.416,47	0,00	5.635,38155800	2,2033060000
06/12/2019	BB PREV ACOES GV	32.485,76	0,00	11.061,96439100	2,9367080610
10/12/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	26.987,18	12.997,71210800	2,0763021380
10/12/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	60.790,35	29.278,18109293	2,0763021380
17/12/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	166.389,33	75.560,41726400	2,2020700000
18/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	386.361,79	0,00	22.074,21027616	17,5028590000
18/12/2019	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	201.580,07	0,00	142.519,54358100	1,4144030000
18/12/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	117.588,37	0,00	39.463,44873500	2,9796780000
18/12/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	117.588,37	0,00	6.173,71371800	19,0466185110
18/12/2019	BB PREV ALOC FIC	201.580,07	0,00	139.333,52121800	1,4467449630
19/12/2019	FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA	67.193,36	0,00	34.981,61981900	1,9208190000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
19/12/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.562,45	0,00	240,13087900	18,9998470980
19/12/2019	BB PREV ACOES GV	201.580,07	0,00	66.100,43250500	3,0496028900
20/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	206.942,21	0,00	11.819,67202160	17,5082870000
20/12/2019	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	7.821,34	0,00	5.534,67317400	1,4131530000
20/12/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	4.593,31	0,00	2.085,54090700	2,2024550000
20/12/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4.562,45	0,00	1.531,90253400	2,9782900000
20/12/2019	BB AÇÕES ENERGIA FI	7.821,34	0,00	487,53146200	16,0427390000
20/12/2019	BB AÇÕES ENERGIA FI	201.580,07	0,00	12.565,19039500	16,0427390000
20/12/2019	BB PREV ACOES GV	7.821,34	0,00	2.564,68094000	3,0496347040
20/12/2019	BB PREV ALOC FIC	7.821,34	0,00	5.417,17536700	1,4438040990
23/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	618.483,16	0,00	35.319,70197469	17,5109960000
23/12/2019	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	218.288,17	0,00	154.280,12371300	1,4148820000
23/12/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	445.772,35	202.148,65532800	2,2051710000
23/12/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	127.334,77	0,00	42.696,84897400	2,9822990000
23/12/2019	FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA	2.607,11	0,00	1.336,97331600	1,9500090000
23/12/2019	BB AÇÕES ENERGIA FI	218.288,17	0,00	13.360,25011600	16,3386290000
23/12/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	127.334,77	0,00	6.678,15768400	19,0673500110
23/12/2019	BB PREV ACOES GV	218.288,19	0,00	71.072,89078500	3,0713284290
23/12/2019	BB PREV ALOC FIC	218.288,17	0,00	150.967,49839000	1,4459282450
26/12/2019	FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA	72.762,72	0,00	36.817,10889200	1,9763290000
27/12/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	13.133,07	0,00	5.944,22246200	2,2093840000
31/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	249.494,67	0,00	14.236,84243713	17,5245790000
31/12/2019	BB AÇÕES ENERGIA FI	88.056,94	0,00	5.291,30690200	16,6418130000
31/12/2019	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	41.581,94	0,00	2.170,81925800	19,1549525970
31/12/2019	BB PREV ACOES GV	88.056,94	0,00	28.627,21986300	3,0759864360
31/12/2019	BB PREV ALOC FIC	88.056,94	0,00	60.567,97889400	1,4538530360

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,34	3.057.728,93	10,33
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,28	0,00	0,00
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,58	0,22	1,15	19,53	0,00
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,23	0,59	5.161.986,36	17,43
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,23	0,60	930.484,45	3,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,23	0,61	532.649,23	1,80
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	0,28	1,19	4.966.400,62	16,77
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	0,28	1,21	2.286.293,01	7,72
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	2,31	0,34	2,09	221.456,78	0,75
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	0,31	0,96	5.552.437,06	18,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,33	0,70	1.428.920,95	4,83
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1+ FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	0,33	0,69	1.551.508,17	5,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	8,55	1,26	8,13	601.893,34	2,03
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	8,64	1,02	2,72	267.187,41	0,90
FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	8,90	1,35	9,36	721.122,24	2,44
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	9,15	1,30	7,56	1.314.728,22	4,44
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	9,24	1,49	11,76	723.594,99	2,44
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	9,73	1,32	6,84	294.657,66	1,00