



**CANOINHAS**  
AGOSTO 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 21.09.2020.

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

#### RENTA FIXA

71,08%

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,09	2,78	1.722.802,83	4,19	7.749.783.927,00	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	5.623.698,35	13,69	5.638.549.883,16	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,10	2,83	715.994,19	1,74	10.245.504.415,29	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,42	-0,72	2,54	953.165,72	2,32	1.263.621.088,83	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	4.892.871,50	11,91	12.740.710.327,20	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,03	0,79	4,80	1.761.901,82	4,29	8.901.363.723,20	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,90	-0,77	5,06	4.453.549,64	10,84	16.114.955.012,29	0,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	2,63	2.176.395,24	5,30	10.897.747.304,90	0,02
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	4.572.700,29	11,13	13.462.808.031,45	0,03
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,20</b>	<b>-0,58</b>	<b>3,43</b>	<b>26.873.079,58</b>	<b>65,41</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	116.704,85	0,28	2.572.617.697,19	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,08	1,42	343.911,14	0,84	1.775.186.405,18	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,63	-0,12	2,70	1.868.427,86	4,55	5.008.664.363,26	0,04
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>1,39</b>	<b>-0,06</b>	<b>2,38</b>	<b>2.329.043,85</b>	<b>5,67</b>		

<b>Renda Fixa</b>			<b>6,75</b>	<b>-0,53</b>	<b>3,30</b>	<b>29.202.123,43</b>	<b>71,08</b>		
-------------------	--	--	-------------	--------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,32%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	44,80	-3,25	-14,62	1.053.242,73	2,56	1.002.237.416,93	0,11
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,48	-3,43	-14,10	1.056.665,64	2,57	683.983.509,09	0,15
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>53,36</b>	<b>-3,34</b>	<b>-14,36</b>	<b>2.109.908,37</b>	<b>5,14</b>		

## 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
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	38,54	-6,01	-22,50	262.436,64	0,64	270.846.204,75	0,10
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,25	-0,43	-4,31	1.220.066,75	2,97	2.421.513.673,79	0,05
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,96	-3,12	-11,76	573.663,95	1,40	1.018.121.260,04	0,06
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,51	-1,38	-15,36	292.238,59	0,71	1.226.260.606,95	0,02
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	41,22	-1,41	-7,94	1.375.456,50	3,35	1.880.767.542,38	0,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,10	-0,20	-16,55	831.502,78	2,02	3.382.143.848,22	0,02
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	47,86	0,31	22,63	306.575,09	0,75	602.196.359,15	0,05
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	38,73	-4,73	8,24	270.596,98	0,66	146.539.041,73	0,18
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	44,61	-3,67	77,72	2.294.530,68	5,58	1.132.505.119,79	0,20
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>54,04</b>	<b>-2,19</b>	<b>-9,27</b>	<b>7.427.067,96</b>	<b>18,08</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,69	-0,14	0,22	455.509,80	1,11	5.030.518.008,95	0,01
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>7,69</b>	<b>-0,14</b>	<b>0,22</b>	<b>455.509,80</b>	<b>1,11</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>50,59</b>	<b>-2,34</b>	<b>-10,96</b>	<b>9.992.486,13</b>	<b>24,32</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,60%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	34,82	7,63	7,63	430.517,09	1,05	250.377.603,90	0,17
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	29,16	15,26	15,26	1.461.029,08	3,56	678.997.370,55	0,22
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>17,64</b>	<b>11,44</b>	<b>11,44</b>	<b>1.891.546,17</b>	<b>4,60</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>17,64</b>	<b>11,44</b>	<b>11,44</b>	<b>1.891.546,17</b>	<b>4,60</b>		
<b>Total</b>						<b>41.086.155,73</b>	<b>100,00</b>		

## 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	26.873.079,58	65,41	50,00	65,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	2.329.043,85	5,67	0,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	29.202.123,43	71,08				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	2.109.908,37	5,14	0,00	7,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	7.427.067,96	18,08	0,00	11,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	455.509,80	1,11	0,00	3,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	9.992.486,13	24,32				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	1.891.546,17	4,60	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.891.546,17	4,60				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,58 -363,04	3,43 162,35	2,14 377,26	2,34 163,47		-157.253,10	893.270,80
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,06 -37,04	2,38 112,38	0,72 126,97	1,76 122,55		-1.615,60	55.858,33
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,34 0,10	-14,36 -0,28	14,00 0,30	-4,85 -0,24		-72.918,78	-60.131,01
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,19 1,26	-9,27 4,81	18,24 4,55	-1,62 2,99		-165.965,42	815.231,89
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,14 3,31	0,22 14,30	2,54 -11,15	1,07 5,68		-623,16	1.011,82
Artigo 9º A, II % do CDI	11,44 7.156,84	11,44 7.156,84				91.546,17	91.546,17
						-306.829,89	1.796.788,00

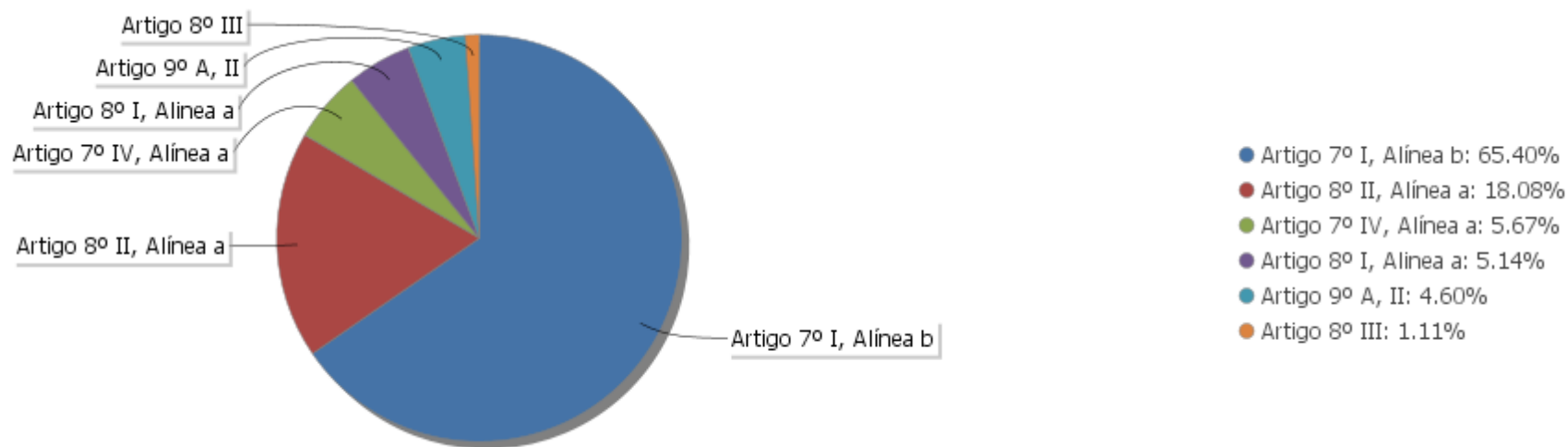
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	36.508.293,68	88,86	36.508.293,68	88,86
de 31 a 364 dias	4.577.862,05	11,14	41.086.155,73	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	41.086.155,73	100,00

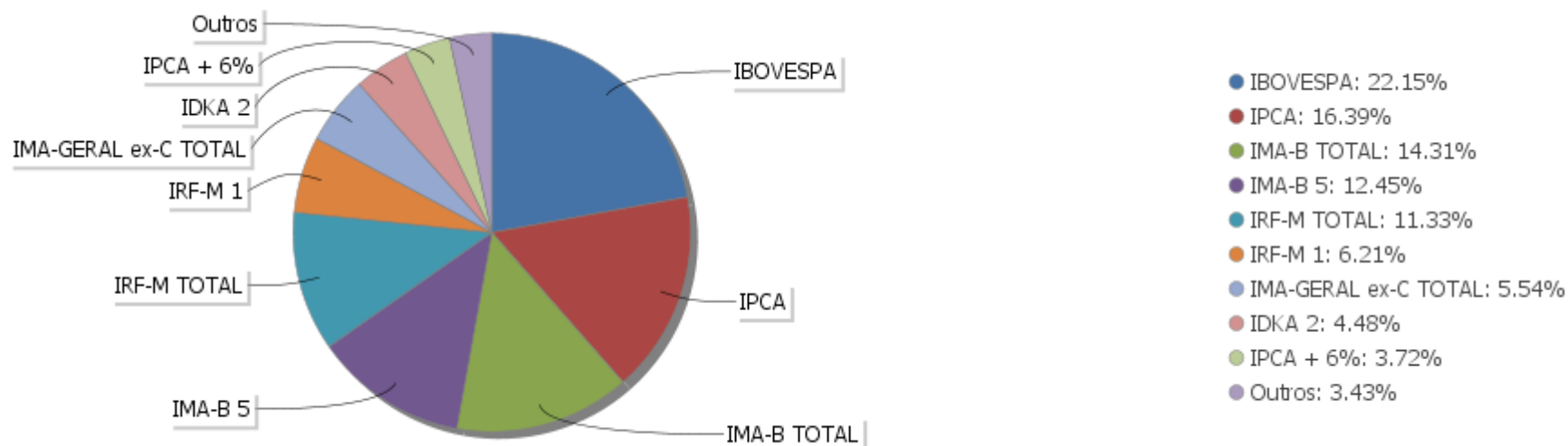


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo



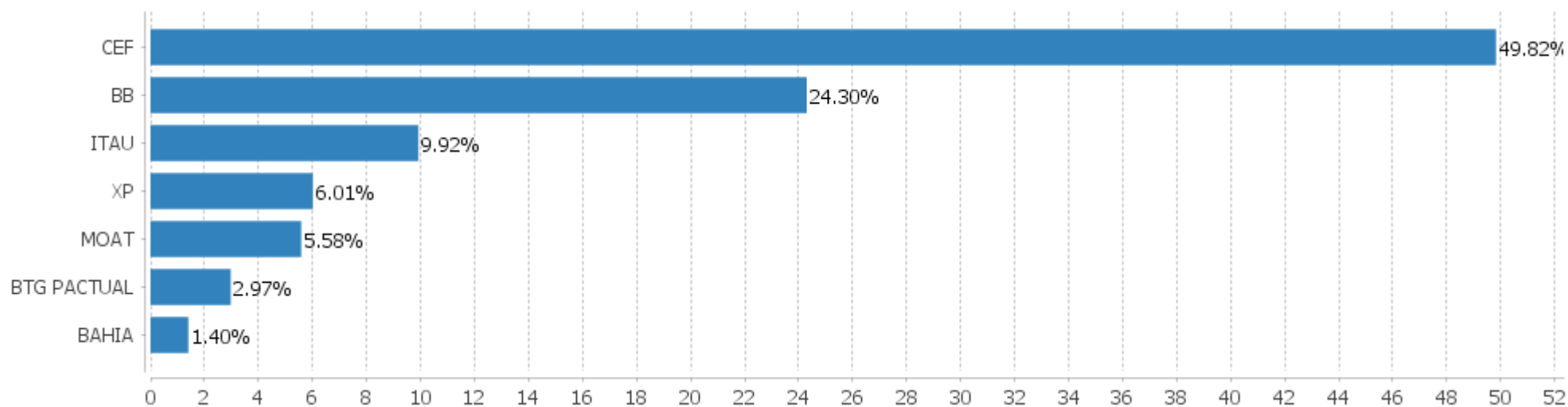
### Alocação Por Estratégia





## 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	0,35	-0,86	-6,80	3,31	2,77	3,07	3,42	-0,76					4,14
IPCA + 6%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73					4,66
p.p. indexador	-0,37	-1,53	-7,38	3,16	2,69	2,32	2,52	-1,49					-0,52

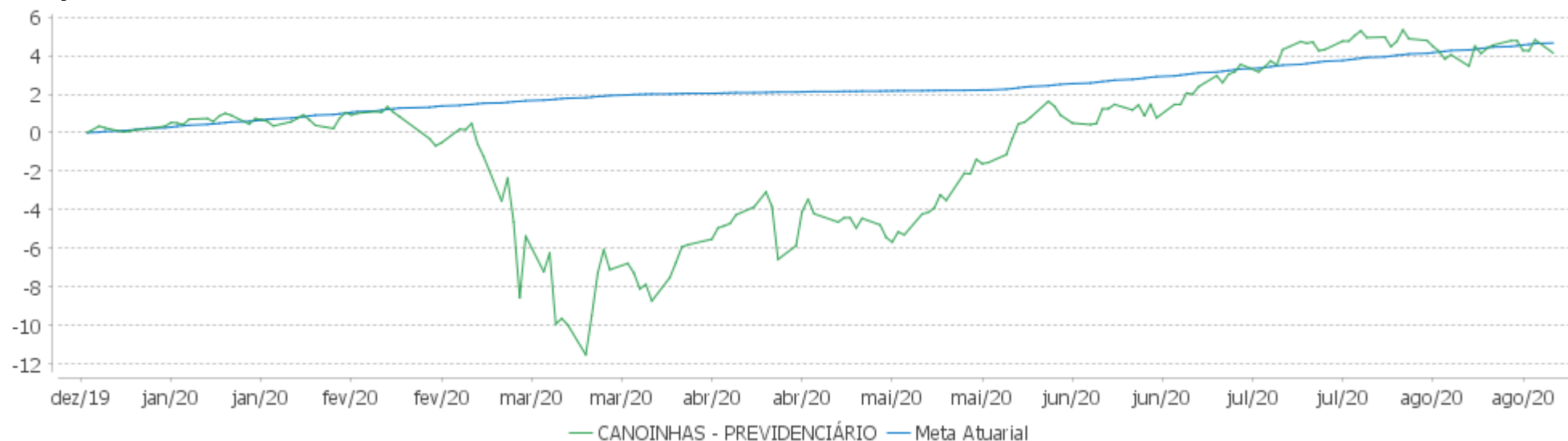
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

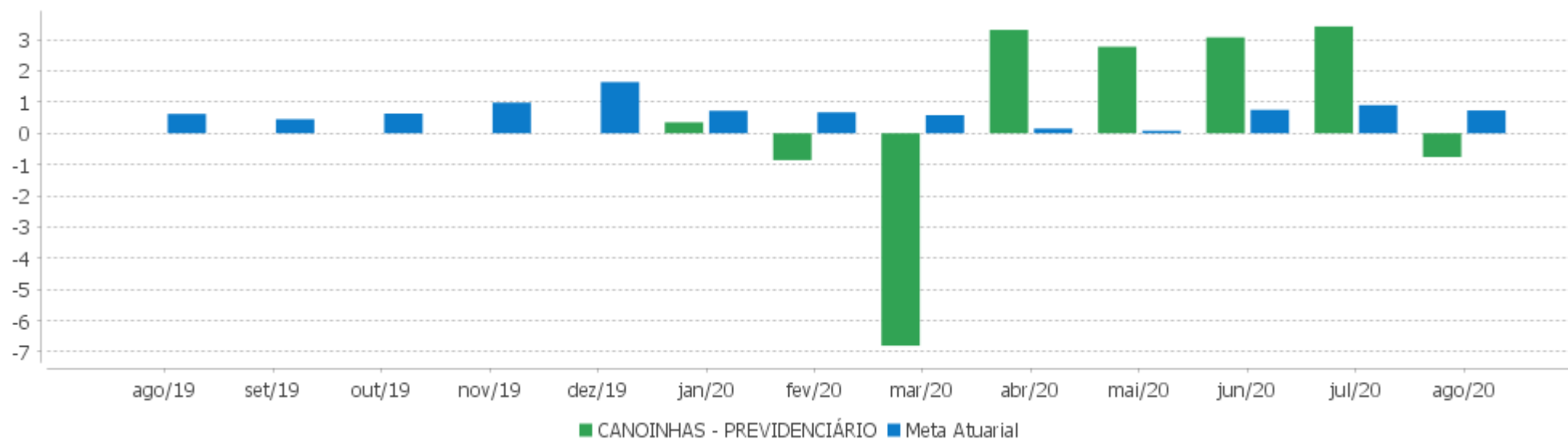
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	4	50,00	03 meses	5,78	2,39	3,40	6,65
Meses abaixo da Meta Atuarial	4	50,00	06 meses	4,68	3,22	1,46	15,60
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,42	2020-07	Desde 31/12/2019	4,14	4,66	-0,52	13,77
Menor rentabilidade da Carteira	-6,80	2020-03					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,18 113,33	1,79 84,85	0,68 119,59	1,16 81,13	3,42 88,51	9,79 94,28	17,31 96,60
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,08 47,03	1,42 67,24	0,31 54,01	0,91 63,80	2,78 72,12	8,08 77,81	14,23 79,42
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,12 -0,36	2,70 2,00	0,86 0,00	2,09 1,85	4,74 2,30	18,63 12,68	27,48 17,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,03	4,45 -0,18	2,48 -0,07	3,24 -0,15	8,93 -0,32	24,43 -0,58	32,42 -0,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,89 -0,21	2,63 -0,06	1,82 -0,06	1,67 -0,06	6,05 -0,11	23,16 0,44	30,22 0,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,09 -0,03	2,78 -0,18	0,58 -0,06	1,99 -0,13	4,77 -0,29	12,31 -0,53	19,76 -0,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,56 -0,80	5,06 4,36	1,17 0,30	3,57 3,33	9,21 6,77	27,35 21,40	34,93 24,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,79 -0,24	4,80 -0,59	2,82 -0,16	3,70 -0,42	8,84 -0,87	21,88 -1,64	30,88 -2,56
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	6,38 -0,26	35,28 -0,71	41,12 -1,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,10 -0,02	2,83 -0,13	0,60 -0,04	2,03 -0,10	4,85 -0,21	12,44 -0,40	19,97 -0,65
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,72 -0,12	2,54 -0,48	1,82 -0,31	1,60 -0,39	5,94 -0,57	22,25 -1,11	29,11 -1,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 -0,02	5,06 -0,15	1,08 -0,03	3,53 -0,09	8,49 -0,22	26,36 -0,46	33,44 -0,90
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,43 3,01	-1,08 12,99	18,99 5,30	4,39 9,00	10,14 11,89	69,23 39,64	75,54 35,26
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,67 -0,23	77,72 32,30	22,21 8,52				
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,38 2,06	-15,36 -1,28	21,66 7,96	-7,86 -3,25	3,92 5,67	51,07 21,47	48,05 7,76
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,41 2,03	-7,94 6,13	20,22 6,53	-2,42 2,19	3,73 5,47	48,78 19,18	64,38 24,10
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-3,12	-11,76	15,50	-4,27	2,31	33,10	52,50

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	2,31	1,81	0,34	4,06	3,51	12,22
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-6,01	-22,50	0,60	-16,67	-7,25	31,54	25,77
Var. IBOVESPA p.p.	-2,57	-8,42	-13,09	-12,06	-5,50	1,94	-14,51
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,20	-16,55	17,29	-7,31	-2,64	42,50	58,37
XP INVESTOR 30 FIC FIA	0,31	-10,42	18,75	-7,82	6,62	55,87	67,93
Var. IBOVESPA p.p.	3,75	3,66	5,05	-3,21	8,36	26,28	27,65
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	-4,73	-23,29	7,45	-18,85	-9,63	47,16	38,65
Var. IBOVESPA p.p.	-1,29	-9,21	-6,24	-14,24	-7,88	17,56	-1,63
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,14	0,22	2,54	1,07	5,57	24,78	33,38
% do CDI	-85,44	10,53	446,83	74,45	144,26	238,71	186,25
FIA BRASIL IBX-50	-3,25	-14,62	14,57	-4,97	-2,43	24,25	35,75
Var. IBOVESPA p.p.	0,19	-0,55	0,88	-0,36	-0,69	-5,35	-4,54
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,43	-14,10	13,42	-4,74	-1,87	28,69	38,62
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	-0,03	-0,27	-0,13	-0,13	-0,90	-1,67
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	7,63	30,85	19,13	35,03			
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,80	-9,60	3,38	-3,69			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	15,26	80,84	28,22	71,29			
Var. IPCA + 6% p.p.	14,53	76,18	25,83	68,06			
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

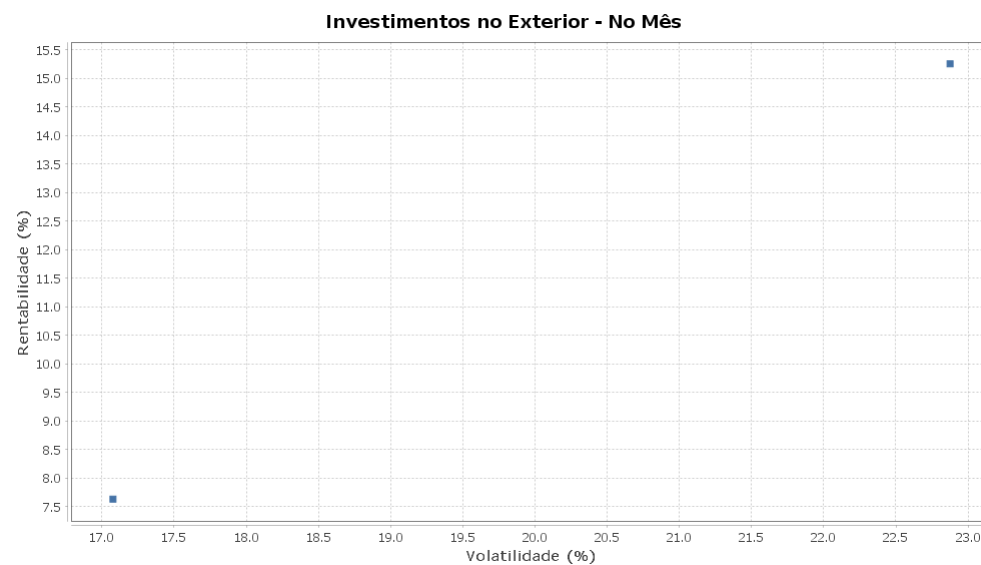
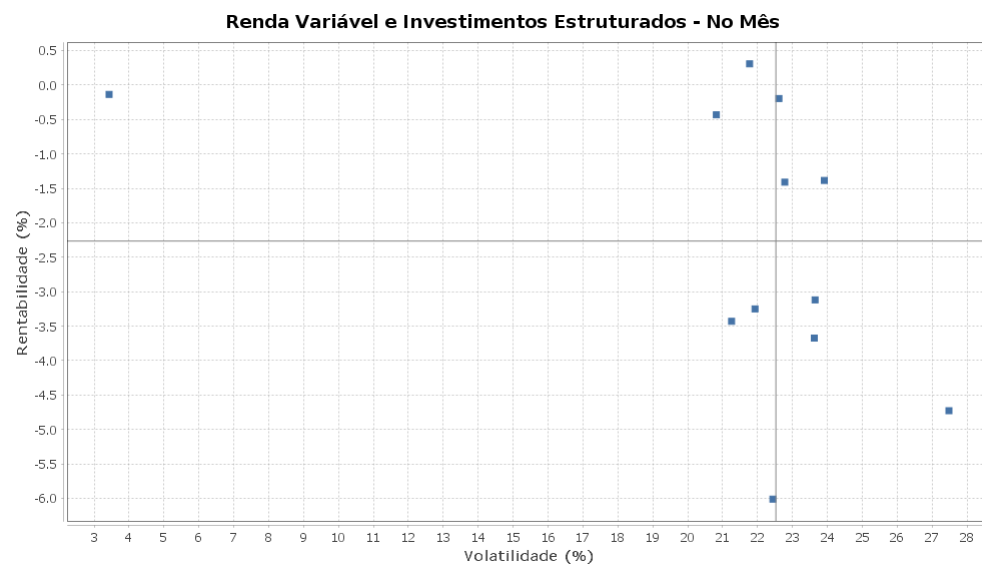
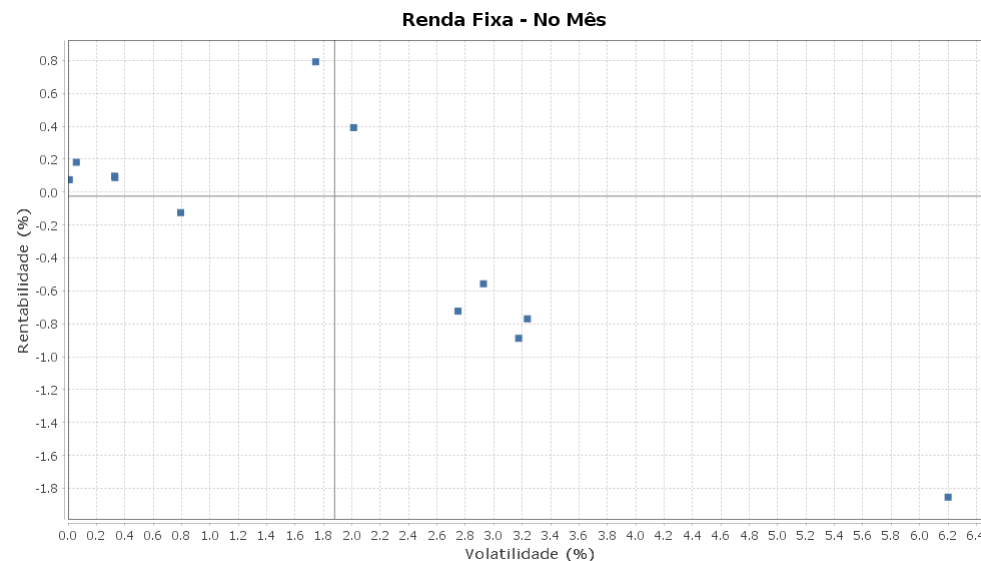
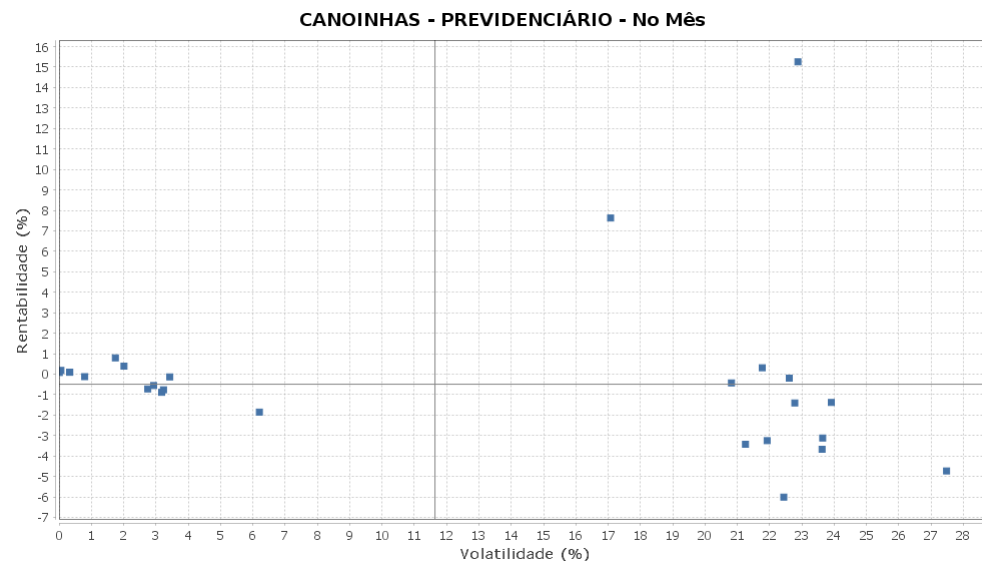
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
137	05/08/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	15.348,38	0,00	10.258,17917149	1,4962090000
142	05/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	28.601,56	13.565,81688400	2,1083551580
143	10/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.657,31	0,00	3.631,47335000	2,1085959500
144	14/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.528,38	0,00	2.621,47926900	2,1088780160
145	18/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.129.078,36	0,00	535.356,61697300	2,1090210230
146	20/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.845,19	0,00	2.771,35191400	2,1091475140
139	27/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	616.493,61	0,00	237.812,82837027	2,5923480000
147	27/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.000.003,13	474.043,81162700	2,1095162630
141	28/08/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.000.000,00	369.397,59245700	2,7071102260
148	28/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,48370700	2,1095802400
140	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48,43	0,00	18,67846847	2,5928250000
149	31/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	99.231,01	47.036,52631700	2,1096585520
157	31/08/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	5.370,85642502	186,1900451000



## 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	0,01	0,02	0,00	-9,48	0,08	343.911,14	0,84
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,07	0,00	0,37	0,18	116.704,85	0,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,19	0,10	715.994,19	1,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,22	0,09	1.722.802,83	4,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,79	0,55	0,02	-0,36	-0,12	1.868.427,86	4,55
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,92	0,02	0,36	0,79	1.761.901,82	4,29
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,08	0,12	0,39	4.892.871,50	11,91
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,75	1,25	0,02	-0,32	-0,72	953.165,72	2,32
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,12	-0,24	-0,56	4.572.700,29	11,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,06	-0,33	-0,89	2.176.395,24	5,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,46	0,12	-0,29	-0,77	4.453.549,64	10,84
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,43	2,23	0,02	-0,09	-0,14	455.509,80	1,11
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,20	3,11	0,34	-0,32	-1,85	5.623.698,35	13,69
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	17,08	11,13	0,03	0,44	7,63	430.517,09	1,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,82	12,70	0,34	-0,03	-0,43	1.220.066,75	2,97
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,25	12,11	0,29	-0,17	-3,43	1.056.665,64	2,57
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,77	14,27	0,10	0,01	0,31	306.575,09	0,75
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	21,92	12,38	0,30	-0,16	-3,25	1.053.242,73	2,56
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,44	13,76	0,08	-0,28	-6,01	262.436,64	0,64
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,61	15,73	0,30	-0,02	-0,20	831.502,78	2,02
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	22,78	13,39	0,42	-0,07	-1,41	1.375.456,50	3,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	22,88	15,04	-0,13	0,66	15,26	1.461.029,08	3,56
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,62	16,34	0,87	-0,16	-3,67	2.294.530,68	5,58
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,64	12,31	0,16	-0,14	-3,12	573.663,95	1,40
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	23,91	15,55	0,10	-0,06	-1,38	292.238,59	0,71
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	27,48	14,80	0,09	-0,18	-4,73	270.596,98	0,66