



**LDB**  
EMPRESAS

**MOGI DAS CRUZES**  
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 22.09.2020.

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

70,41%

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	61.354,74	0,01	7.749.783.927,00	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,54	-1,81	0,57	14.040.276,60	2,06	763.616.162,98	1,84
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	109.072.871,11	16,01	6.019.680.821,86	1,81
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,09	2,79	15.314,47	0,00	170.663.986,67	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,10	2,83	78.600,33	0,01	10.245.504.415,29	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	112.666.528,53	16,54	12.740.710.327,20	0,88
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,59	-1,82	0,38	20.050.478,43	2,94	1.145.871.824,82	1,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,90	-0,77	5,06	31.328.084,37	4,60	16.114.955.012,29	0,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,03	-0,30	6,37	2.488.592,32	0,37	665.936.850,13	0,37
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,37	4,46	13.190.226,14	1,94	4.251.005.212,54	0,31
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,39	0,76	4,51	13.842.406,58	2,03	456.125.561,92	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	2,63	55.921.543,62	8,21	10.897.747.304,90	0,51
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	66.429.661,27	9,75	13.462.808.031,45	0,49
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,08	0,42	3,69	2.840.678,29	0,42	570.737.914,69	0,50
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,32</b>	<b>-0,70</b>	<b>3,49</b>	<b>442.026.616,80</b>	<b>64,90</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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,31	0,25	1,42	5.060.143,48	0,74	1.714.611.822,66	0,30
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	13,88	-1,95	0,47	5.840.097,49	0,86	286.847.090,95	2,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,54	-1,79	0,52	2.932.725,91	0,43	1.456.021.562,44	0,20
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,63	-0,12	2,70	23.738.749,83	3,49	5.008.664.363,26	0,47
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,03</b>	<b>-0,43</b>	<b>2,00</b>	<b>37.571.716,71</b>	<b>5,52</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

6,98

-0,68

3,36

479.598.333,51

70,41

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,61%

## Artigo 8º I, Alínea b (Fundos de Índices Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	70,57	-3,45	-14,09	31.397.848,79	4,61	4.222.717.167,97	0,74
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea b</b>			<b>70,57</b>	<b>-3,45</b>	<b>-14,09</b>	<b>31.397.848,79</b>	<b>4,61</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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	42,58	-1,81	-17,46	4.138.130,71	0,61	576.020.291,87	0,72
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,97	-4,49	-20,32	736.104,51	0,11	1.500.161.277,42	0,05
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	46,97	-1,95	-16,60	16.976.991,87	2,49	646.817.966,25	2,62
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	40,47	-3,39	-12,35	25.368.133,40	3,72	280.506.287,87	9,04
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,10	-4,82	39,88	9.232.141,13	1,36	584.076.702,07	1,58
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,05	-0,70	-0,70	1.354.935,88	0,20	470.473.543,85	0,29
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	47,86	0,31	-10,42	18.152.070,49	2,66	602.196.359,15	3,01
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,72	-3,55	-15,94	1.879.341,37	0,28	901.803.096,40	0,21
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	38,93	-3,82	-13,31	10.110.895,14	1,48	819.770.596,51	1,23
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,28	-3,45	50,03	9.901.709,65	1,45	869.679.380,09	1,14
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	40,35	-4,48	14,03	7.526.046,86	1,10	246.276.071,37	3,06
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	48,23	0,48	21,97	2.041.882,66	0,30	1.022.247.498,85	0,20
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	37,17	-5,47	-13,36	12.927.054,24	1,90	185.198.268,16	6,98
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>42,48</b>	<b>-2,98</b>	<b>-14,76</b>	<b>120.345.437,91</b>	<b>17,67</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32,04	6,92	5,71	12.400.615,89	1,82	1.014.136.007,41	1,22
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,74	-0,21	4,84	3.480.066,90	0,51	288.179.143,57	1,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		<b>Sub-total Artigo 8º III</b>	<b>24,57</b>	<b>5,27</b>	<b>5,52</b>	<b>15.880.682,79</b>	<b>2,33</b>		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	38,37	-2,34	-9,75	167.623.969,49	24,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,98%

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
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,75	13,92	72,26	3.512.060,73	0,52	104.699.210,62	3,35
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	29,16	15,26	80,84	22.342.616,59	3,28	678.997.370,55	3,29
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>26,84</b>	<b>15,07</b>	<b>79,85</b>	<b>25.854.677,32</b>	<b>3,80</b>		

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	30,94	16,00	46,26	8.058.495,07	1,18	1.489.928.271,86	0,54
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>30,94</b>	<b>16,00</b>	<b>46,26</b>	<b>8.058.495,07</b>	<b>1,18</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>26,20</b>	<b>15,24</b>	<b>64,47</b>	<b>33.913.172,39</b>	<b>4,98</b>		
<b>Total</b>						<b>681.135.475,39</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	442.026.616,80	64,90	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	37.571.716,71	5,52	2,00	1,14	40,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>479.598.333,51</b>	<b>70,41</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	31.397.848,79	4,61	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	120.345.437,91	17,67	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.880.682,79	2,33	0,00	2,00	10,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>167.623.969,49</b>	<b>24,61</b>				
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	25.854.677,32	3,80	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.058.495,07	1,18	0,00	1,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>33.913.172,39</b>	<b>4,98</b>				



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

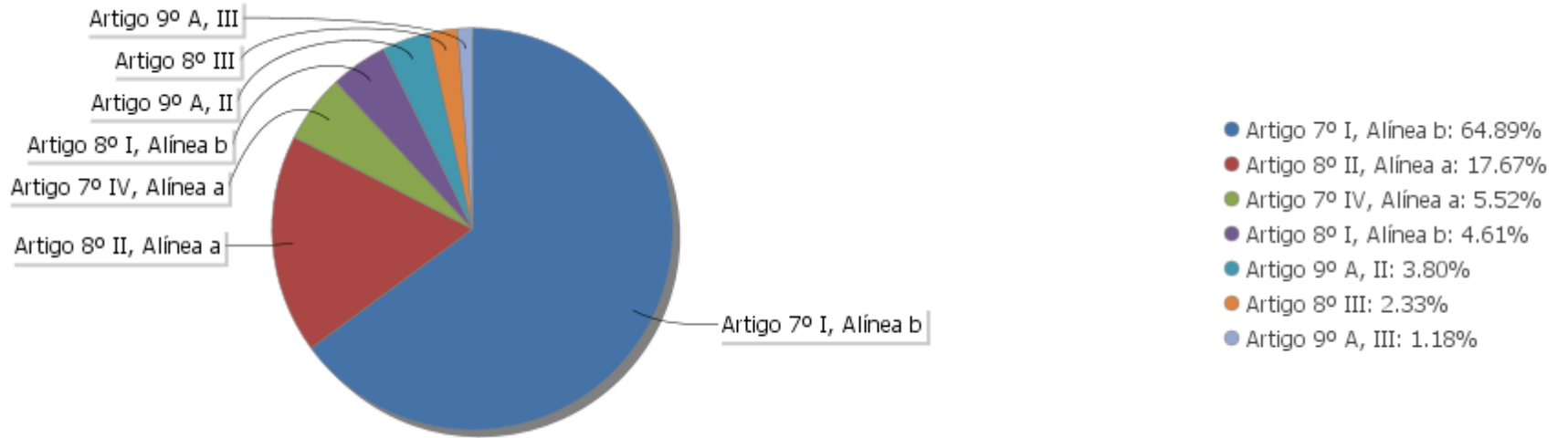
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,70 -439,91	3,49 165,08	2,73 480,95	2,36 164,28	7,95 205,83	-3.168.378,04	12.635.682,09
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,43 -270,20	2,00 94,40	1,52 267,17	1,37 95,50	4,61 119,33	-164.469,92	756.542,03
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-3,45 -0,01	-14,09 -0,02	13,67 -0,02	-4,64 -0,03	-4,23 -2,48	-1.122.310,85	7.442.012,01
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,98 0,46	-14,76 -0,68	14,06 0,37	-9,70 -5,09	-0,22 1,53	-3.671.751,02	8.361.848,03
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,27 8,71	5,52 19,59	10,83 -2,86	11,53 16,14	15,44 17,19	795.043,33	830.375,13
Artigo 9º A, II % do CDI	15,07 9.427,59	79,85 3.774,99	27,41 4.828,27	66,96 4.669,51		3.319.638,24	9.956.396,09
Artigo 9º A, III % do CDI	16,00 10.006,17	46,26 2.187,04	19,43 3.423,44	44,29 3.088,23	53,66 1.390,17	962.014,76	1.895.058,98
						-3.050.213,50	41.877.914,36

**Análise de Liquidez**

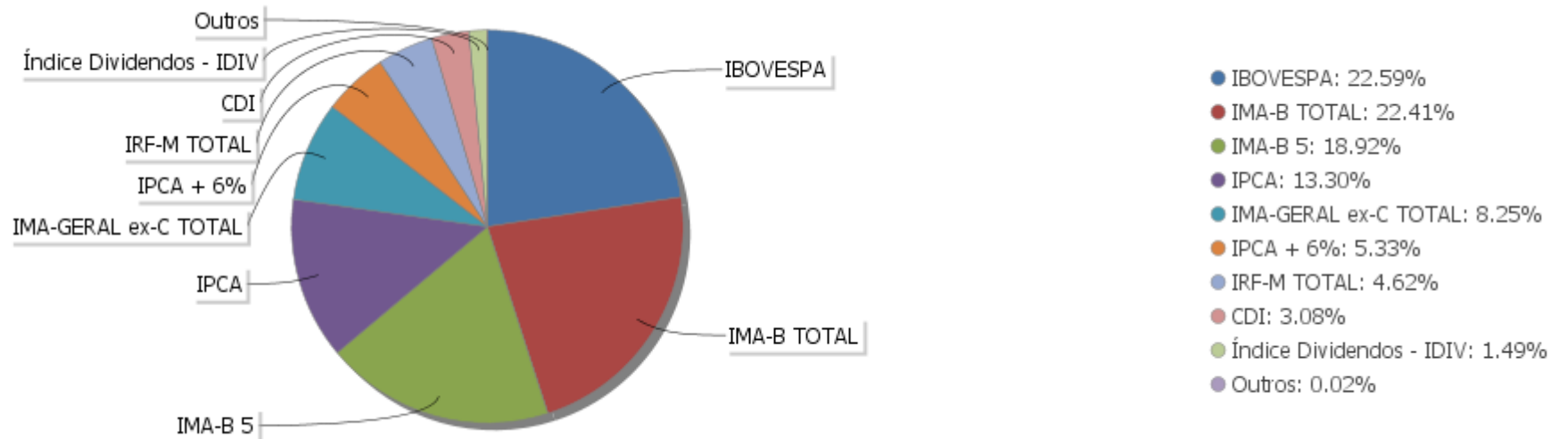
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	604.253.367,34	88,71	604.253.367,34	88,71
de 31 a 364 dias	60.199.023,18	8,84	664.452.390,52	97,55
acima de 365 dias	16.683.084,87	2,45	681.135.475,39	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

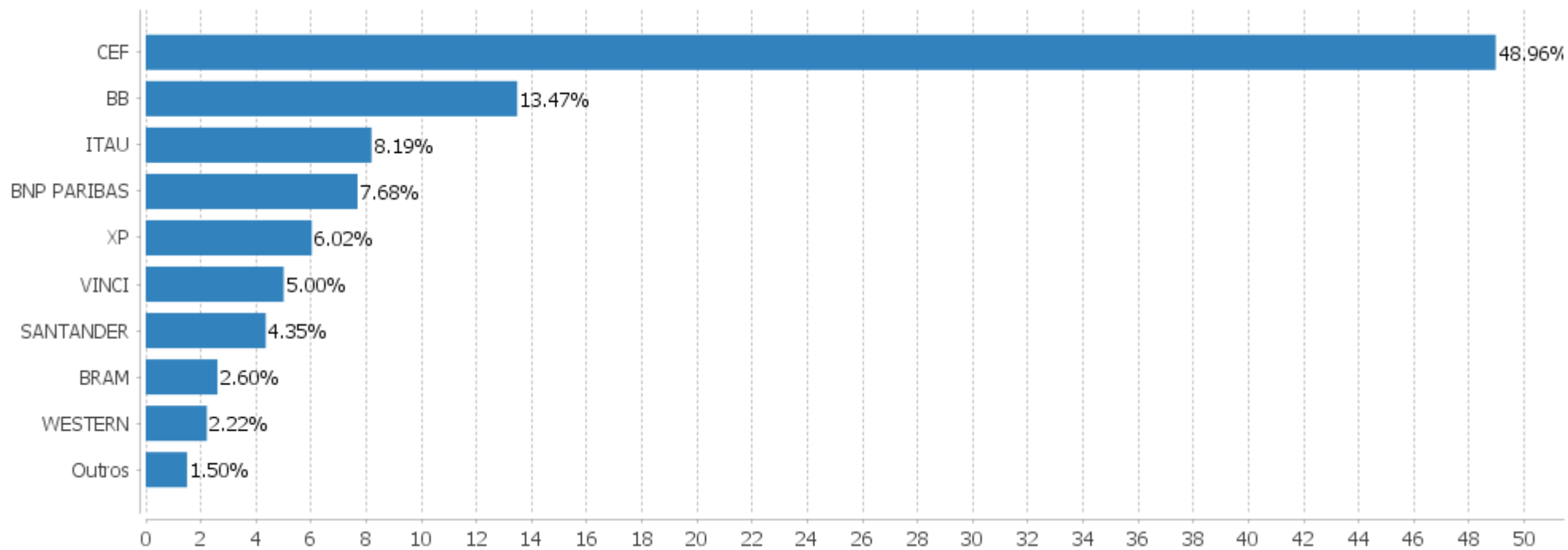


Alocação Por Estratégia



## 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	0,64	-0,53	-5,69	3,28	2,94	2,96	3,43	-0,44					6,41
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72					4,57
p.p. indexador	-0,07	-1,19	-6,26	3,14	2,87	2,22	2,55	-1,16					1,84
2019	2,62	0,40	0,42	1,14	1,92	2,62	1,15	-0,04	2,03	2,09	-0,62	1,88	16,71
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	1,79	-0,50	-0,77	0,09	1,28	2,17	0,42	-0,66	1,58	1,46	-1,59	0,24	6,12
2018	1,78	0,59	0,91	0,37	-1,50	0,13	1,83	-0,52	0,58	3,66	0,79	1,09	10,06
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,98	-0,15	0,34	-0,34	-2,38	-1,62	0,99	-0,96	-0,34	2,70	0,53	0,48	0,14

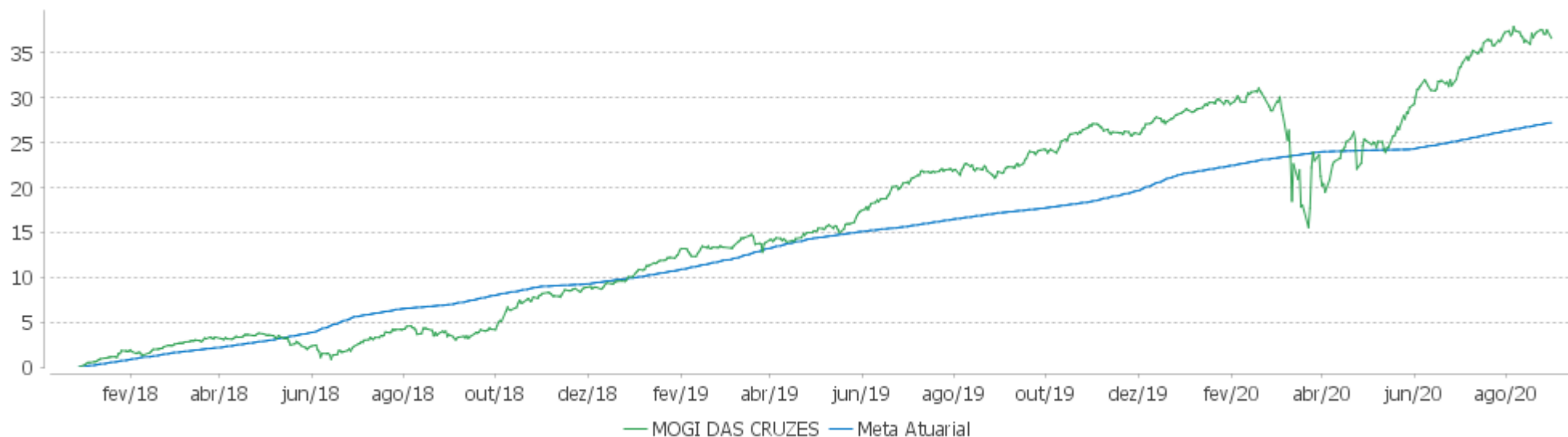
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

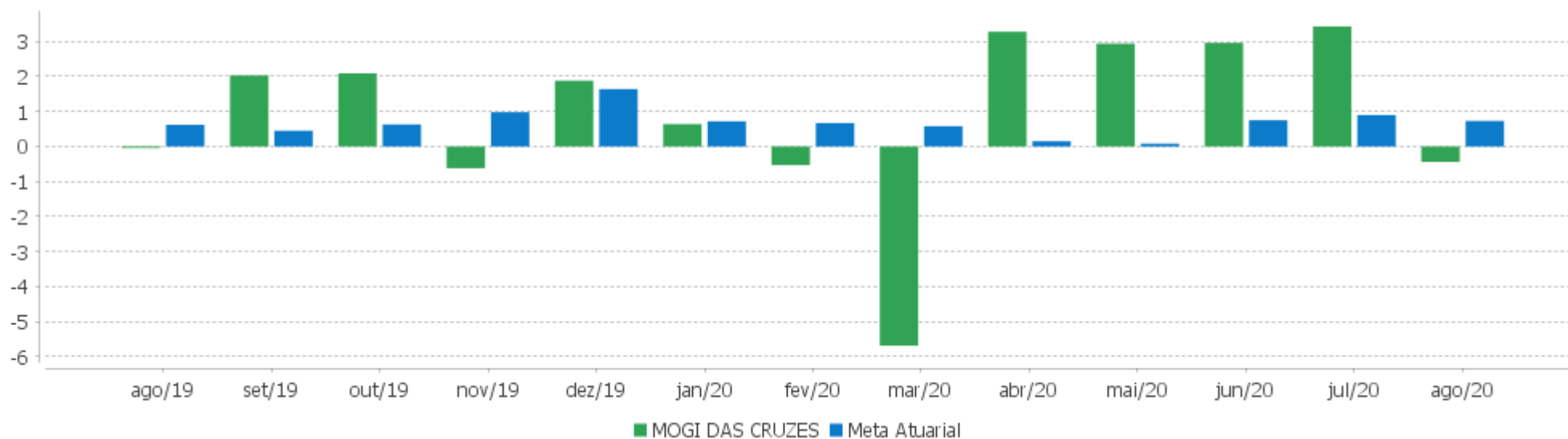
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	56,25	03 meses	6,02	2,35	3,67	5,45
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	43,75	06 meses	6,30	3,16	3,14	14,87
			12 meses	12,23	8,49	3,74	10,80
			24 meses	31,92	18,86	13,07	8,03
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10	Desde 29/12/2017	36,68	27,12	9,57	7,11
Menor rentabilidade da Carteira	-5,69	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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,30 -0,72	6,37 1,74	2,93 0,37	4,35 0,96	11,74 2,50	33,10 8,09	40,99 7,66
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
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 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
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	8,95 -0,29	24,42 -0,59	32,44 -0,89
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,42 -0,42	3,69 -1,45	2,25 -0,38	2,69 -1,11	7,87 -1,24	23,87 4,49	41,96 10,87
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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,81 -0,02	0,57 -0,23	4,53 -0,08	-0,09 -0,18	6,29 -0,35	35,05 -0,94	40,76 -1,44
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,76 0,03	4,51 -0,15	2,61 0,22	3,26 0,04	8,84 0,25	26,23 7,27	43,43 12,10
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
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
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,09 -0,03	2,79 -0,18	0,59 -0,05	2,00 -0,13	4,79 -0,27	12,42 -0,41	19,91 -0,71
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
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,82 -0,03	0,38 -0,43	4,51 -0,10	-0,29 -0,38	6,10 -0,54	34,96 -1,03	40,74 -1,47
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,79 0,00	0,52 -0,28	4,60 -0,01	-0,14 -0,24	6,26 -0,38	35,06 -0,94	41,07 -1,14
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,95 -0,16	0,47 -0,33	4,62 0,01	-0,19 -0,28	6,45 -0,19	36,85 0,86	41,65 -0,55
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,25	1,42	0,55	0,76	3,01	9,48	16,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	153,78	67,13	97,10	52,90	78,03	91,34	94,22
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
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-4,82 -1,37	-12,88 1,20	13,29 -0,40	-8,31 -3,70	4,43 6,17	59,74 30,15	63,41 23,13
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 -1,03	-20,30 -6,23	7,51 -6,18	-14,82 -10,21			
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,82 1,01	-13,31 3,94	8,95 -1,51	-8,81 1,57	-1,14 2,51	48,70 3,92	44,23 -0,97
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,81 1,63	-17,46 -3,38	16,89 3,20	-8,49 -3,88	-6,17 -4,43	30,43 0,83	40,41 0,13
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,31 3,75	-10,42 3,66	18,75 5,05	-7,82 -3,21	6,62 8,36	55,87 26,28	67,93 27,65
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,47 -2,02	-13,36 0,71	9,46 -4,23	-9,95 -5,34	1,40 3,15	43,95 14,36	57,09 16,81
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,49 -1,05	-20,32 -6,25	7,54 -6,15	-14,85 -10,24	-10,03 -8,28	39,22 9,62	45,37 5,09
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,55 -0,11	-15,94 -1,87	10,23 -3,46	-6,32 -1,71	-2,66 -0,92	48,05 18,46	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-3,39 0,06	-12,35 1,72	12,20 -1,50	-5,12 -0,51	1,69 3,44	42,12 12,52	30,87 -9,42
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,52 0,92	-3,24 10,83	15,08 1,39	2,49 7,10	10,71 12,46	50,27 20,68	65,02 24,74
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,48 3,92	-4,23 9,85	22,46 8,77	0,07 4,68	15,87 17,62		
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-1,95 1,50	-16,60 -2,52	21,00 7,31	-11,05 -6,44	2,81 4,56	53,47 23,88	40,41 0,13
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-3,45 -0,01	-10,02 4,06	15,87 2,17	-4,39 0,22	6,16 7,91		
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	-3,45 -0,01	-14,09 -0,02	13,67 -0,02	-4,64 -0,03	-1,81 -0,07	29,75 0,15	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	6,92 4.327,20	5,71 269,97	13,90 2.448,48	13,87 967,00	17,58 455,37	22,78 219,49	50,36 280,99
BRANCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	-0,21 -133,06	4,84 228,61	1,12 198,03	3,95 275,10	8,43 218,38	15,94 153,56	23,38 130,45
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	16,00	46,26	19,43	44,29	53,66	75,37	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IBOVESPA p.p.	19,44	60,33	5,74	48,90	55,41	45,78	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,92	72,26	22,77	53,78	86,11		
Var. IBOVESPA p.p.	17,36	86,33	9,07	58,39	87,85		
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

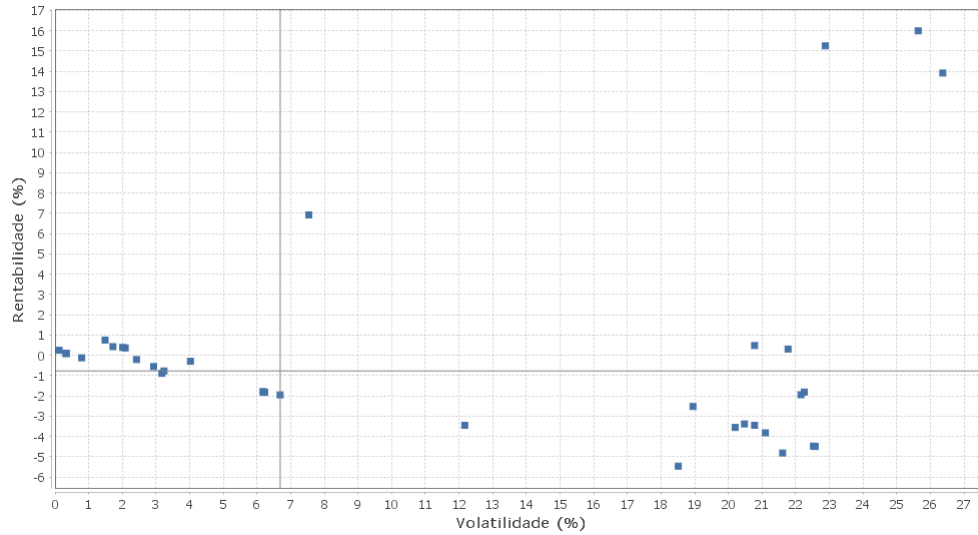
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
128	04/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	13.000,00	70,17712100	185,2455600000
131	04/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	773.000,00	0,00	4.172,83955500	185,2455600000
134	04/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.897.000,00	15.638,70140900	185,2455600000
132	07/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	773.000,00	4.171,48581300	185,3056764000
124	11/08/2020	INDIE FIC FIA	436.000,00	0,00	117.131,69517000	3,7223059000
125	11/08/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	1.745.000,00	0,00	10.386,89454194	168,0001653000
120	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	114.380,82	51.144,66195800	2,2364175580
121	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	1.540.415,79	688.787,20098100	2,2364175580
122	17/08/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	406.565,56	182.535,22570500	2,2273265800
123	17/08/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	2.032.149,50	912.371,59303300	2,2273265800
129	18/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	17.000,00	91,68972000	185,4079189000
135	18/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.010.000,00	10.840,96090400	185,4079189000
119	19/08/2020	BB PREV RF IMA-B	1.364.500,00	0,00	246.800,52818900	5,5287564010
126	20/08/2020	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	1.364.500,00	0,00	2.385,15849400	572,0793830000
136	20/08/2020	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	1.364.500,00	0,00	5.018,14276870	271,9133478000
130	25/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	74.000,00	398,86582700	185,5260469000
133	27/08/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	87.000,00	0,00	468,85925200	185,5567522000

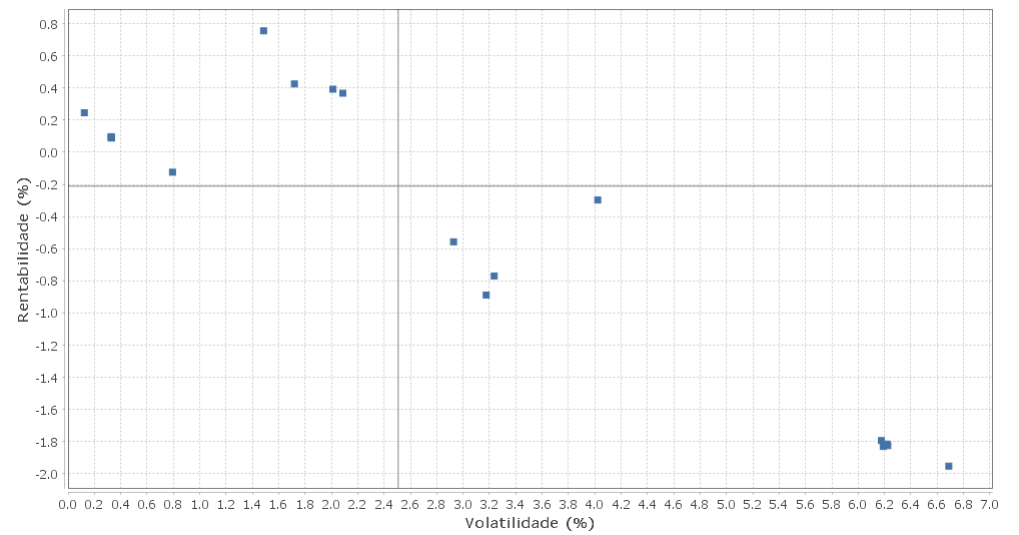
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

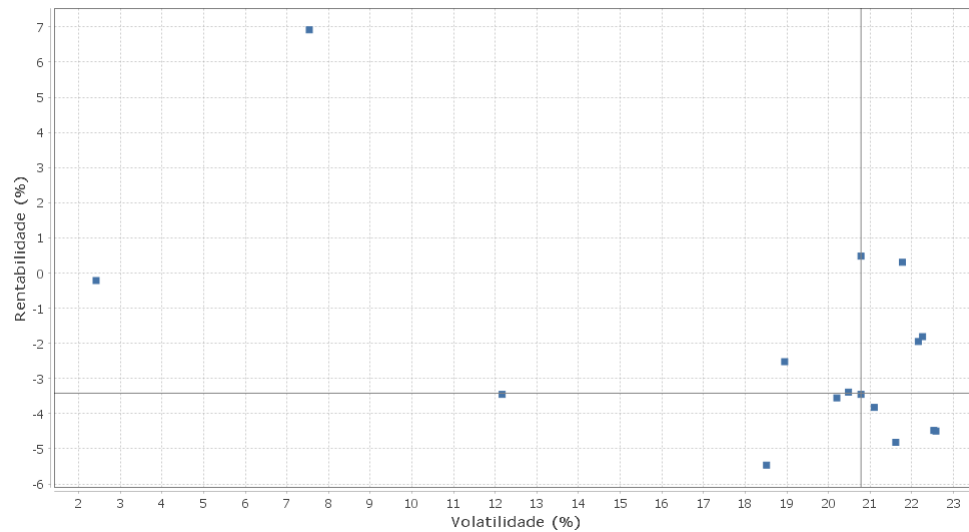
MOGI DAS CRUZES - No Mês



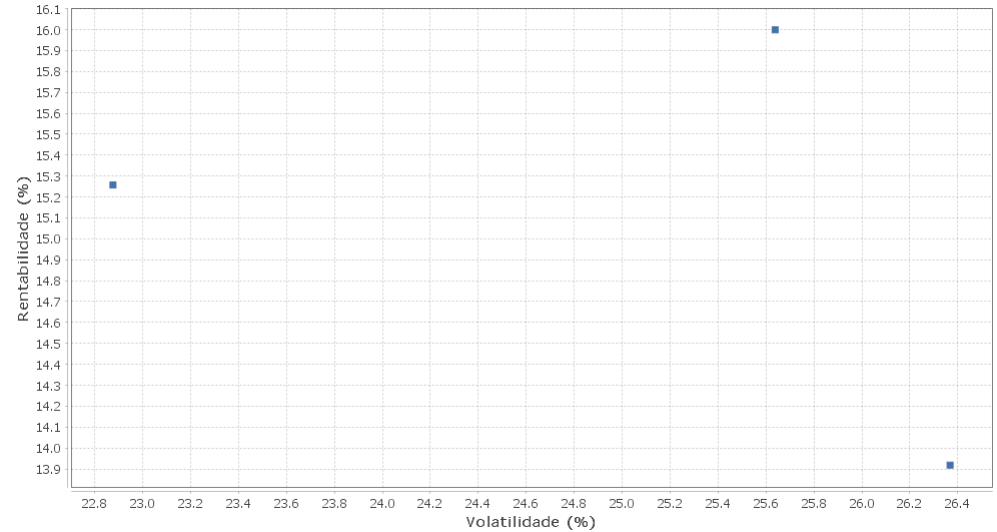
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,12	0,11	-0,00	0,69	0,25	5.060.143,48	0,74
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,21	0,09	15.314,47	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,19	0,10	78.600,33	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,22	0,09	61.354,74	0,01
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,79	0,55	0,01	-0,36	-0,12	23.738.749,83	3,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,48	0,96	0,01	0,40	0,76	13.842.406,58	2,03
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,99	0,00	0,15	0,42	2.840.678,29	0,42
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,12	0,12	0,39	112.666.528,53	16,54
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,09	1,10	0,01	0,10	0,37	13.190.226,14	1,94
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	2,42	1,23	0,00	-0,15	-0,21	3.480.066,90	0,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,10	-0,24	-0,56	66.429.661,27	9,75
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,09	-0,33	-0,89	55.921.543,62	8,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,46	0,05	-0,29	-0,77	31.328.084,37	4,60
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,02	2,28	0,01	-0,11	-0,30	2.488.592,32	0,37
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,18	3,10	0,01	-0,32	-1,79	2.932.725,91	0,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	3,13	0,41	-0,32	-1,83	109.072.871,11	16,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	6,22	3,11	0,05	-0,32	-1,81	14.040.276,60	2,06
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,22	3,11	0,08	-0,32	-1,82	20.050.478,43	2,94
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,69	3,36	0,02	-0,32	-1,95	5.840.097,49	0,86
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	7,54	11,45	0,09	0,90	6,92	12.400.615,89	1,82
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	12,17	1,41	-0,00	-0,30	-3,45	31.397.848,79	4,61
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,51	13,18	0,23	-0,30	-5,47	12.927.054,24	1,90
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,95	12,11	0,02	-0,14	-2,52	1.354.935,88	0,20
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,20	13,11	0,03	-0,18	-3,55	1.879.341,37	0,28
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	20,48	11,72	0,40	-0,17	-3,39	25.368.133,40	3,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	20,78	13,75	0,19	-0,17	-3,45	9.901.709,65	1,45
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,78	13,99	0,04	0,02	0,48	2.041.882,66	0,30
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	13,21	0,18	-0,19	-3,82	10.110.895,14	1,48
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,61	13,36	0,17	-0,23	-4,82	9.232.141,13	1,36
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,77	14,27	0,35	0,01	0,31	18.152.070,49	2,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	22,15	15,47	0,35	-0,10	-1,95	16.976.991,87	2,49
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	22,26	12,34	0,07	-0,09	-1,81	4.138.130,71	0,61
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,53	12,68	0,13	-0,21	-4,48	7.526.046,86	1,10
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,58	12,71	0,01	-0,21	-4,49	736.104,51	0,11
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	22,88	15,04	-0,09	0,66	15,26	22.342.616,59	3,28
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	25,64	11,64	-0,01	0,62	16,00	8.058.495,07	1,18
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,37	13,00	-0,01	0,52	13,92	3.512.060,73	0,52

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

Referente ao mês de agosto de 2020, vale observar que:

- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 17,67% dos recursos totais do Instituto, alocação esta superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos.