



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
MAIO 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 16.06.2020.

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

73,82%

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 PREVID RF IRF-M1	0,54	0,39	2,19	61.001,58	0,01	7.581.218.915,05	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,41	1,49	-3,79	13.431.517,46	2,07	736.279.311,90	1,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	12,48	1,50	-3,82	104.336.364,45	16,04	5.962.762.833,75	1,75
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,39	2,19	15.224,77	0,00	298.597.289,40	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS	0,54	0,39	2,22	78.133,21	0,01	10.824.772.393,85	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00	2,11	1,92	109.936.942,54	16,90	8.882.233.150,63	1,24
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,45	1,49	-3,95	19.185.348,96	2,95	1.300.485.934,94	1,48
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS P	5,85	1,40	3,93	36.395.679,55	5,60	16.970.991.295,24	0,21
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,00	2,90	3,35	2.417.833,65	0,37	568.107.043,95	0,43
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,97	2,11	1,99	12.877.600,82	1,98	4.431.593.608,10	0,29
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,48	1,92	1,85	15.870.866,49	2,44	522.957.884,47	3,03
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	6,08	1,07	0,79	54.921.861,60	8,44	10.653.642.517,78	0,52
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,03	1,38	3,85	65.663.098,54	10,10	12.026.220.422,43	0,55
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,14	1,83	1,41	4.399.497,38	0,68	883.847.989,19	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,28	1,61	0,74	439.590.971,00	67,59		

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	0,26	0,22	0,86	9.911.959,53	1,52	2.557.300.343,58	0,39
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	13,76	1,57	-3,96	5.582.370,28	0,86	306.753.506,14	1,82
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,41	1,54	-3,89	1.504.578,88	0,23	1.446.799.170,09	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,92	0,54	1,82	23.535.455,25	3,62	5.202.369.354,06	0,45
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,08	0,63	0,47	40.534.363,94	6,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

6,95

1,53

0,71

480.125.334,94

73,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,43%

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	75,36	8,56	-24,49	27.621.814,44	4,25	6.261.717.447,78	0,44
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			75,36	8,56	-24,42	27.621.814,44	4,25		

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	42,04	6,02	-29,39	3.540.096,15	0,54	515.812.909,63	0,69
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,20	5,82	-25,90	684.513,15	0,11	1.455.929.520,62	0,05
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	46,07	6,94	-31,07	14.030.932,96	2,16	556.518.549,70	2,52
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	39,60	8,58	-21,88	22.610.518,31	3,48	247.425.546,08	9,14
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	40,67	7,03	23,47	8.149.231,70	1,25	472.940.034,21	1,72
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	47,43	9,47	-24,56	15.286.430,16	2,35	604.306.101,97	2,53
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,12	7,48	-23,74	1.704.958,66	0,26	710.762.724,82	0,24
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	38,32	7,50	-20,43	9.280.254,18	1,43	768.284.939,45	1,21
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,05	7,64	29,48	8.545.897,90	1,31	675.160.336,89	1,27
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	45,65	5,80	6,06	7.000.125,95	1,08	199.714.972,18	3,51
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	48,03	8,28	-0,40	1.307.735,03	0,20	760.668.702,33	0,17
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	36,49	7,10	-20,85	11.809.896,73	1,82	166.345.891,57	7,10
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,91	7,70	-25,27	103.950.590,88	15,98		

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	31,91	5,37	-7,19	10.887.463,16	1,67	867.265.875,78	1,26
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,76	1,17	3,67	3.441.383,08	0,53	209.223.125,29	1,64
Sub-total Artigo 8º III			24,42	4,33	-4,79	14.328.846,24	2,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	38,04	7,52	-20,63	145.901.251,56	22,43
---	-------	------	--------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,74%

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	25,33	3,99	40,31	2.860.773,54	0,44	12.156.536,19	23,53
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	29,19	5,57	41,04	15.916.885,44	2,45	235.083.784,18	6,77
Sub-total Artigo 9º A, II			26,77	5,33	41,16	18.777.658,98	2,89		

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	29,50	3,31	22,46	5.567.213,46	0,86	1.079.247.594,50	0,52
Sub-total Artigo 9º A, III			29,50	3,31	22,46	5.567.213,46	0,86		
Investimentos no Exterior			25,26	4,86	31,00	24.344.872,44	3,74		
Total						650.371.458,94	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	439.590.971,00	67,59	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	40.534.363,94	6,23	2,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	480.125.334,94	73,82				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	27.621.814,44	4,25	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	103.950.590,88	15,98	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	14.328.846,24	2,20	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	145.901.251,56	22,43				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	18.777.658,98	2,89	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.567.213,46	0,86	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.344.872,44	3,74				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

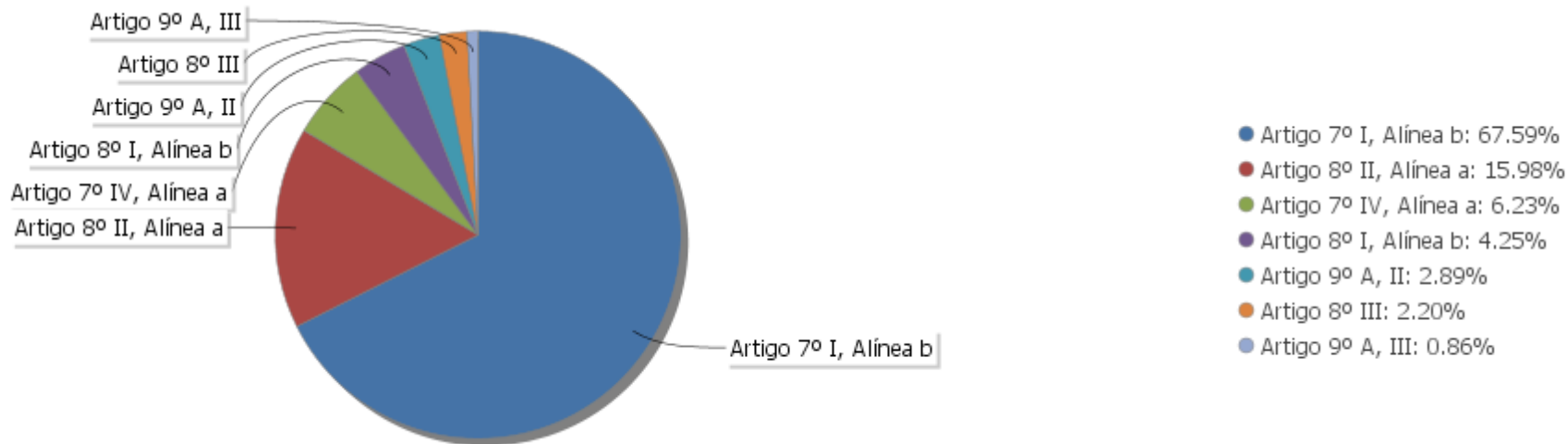
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,61 684,11	0,74 48,18	-0,36 -42,26	1,95 101,39	8,59 176,31	6.978.785,87	606.524,62
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,63 267,32	0,47 30,74	-0,14 -16,81	1,19 62,15	6,46 132,72	254.038,64	195.689,26
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	8,56 -0,01	-24,42 -0,00	-16,11 -0,01	-19,19 0,06		2.177.931,70	3.561.397,25
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,70 -0,86	-25,27 -0,85	-20,84 -4,74	-18,73 0,52	-5,29 4,64	7.433.538,65	-6.232.499,00
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,33 -4,24	-4,79 19,63	0,64 16,73	-2,66 16,59	9,89 19,81	594.694,20	-721.461,42
Artigo 9º A, II % do CDI	5,33 2.259,67	41,16 2.674,81	31,05 3.603,76	37,96 1.977,94		949.946,59	4.624.377,75
Artigo 9º A, III % do CDI	3,31 1.401,59	22,46 1.459,72	20,81 2.415,52	20,97 1.092,47		178.112,26	768.277,37
						18.567.047,91	2.802.305,83

Análise de Liquidez

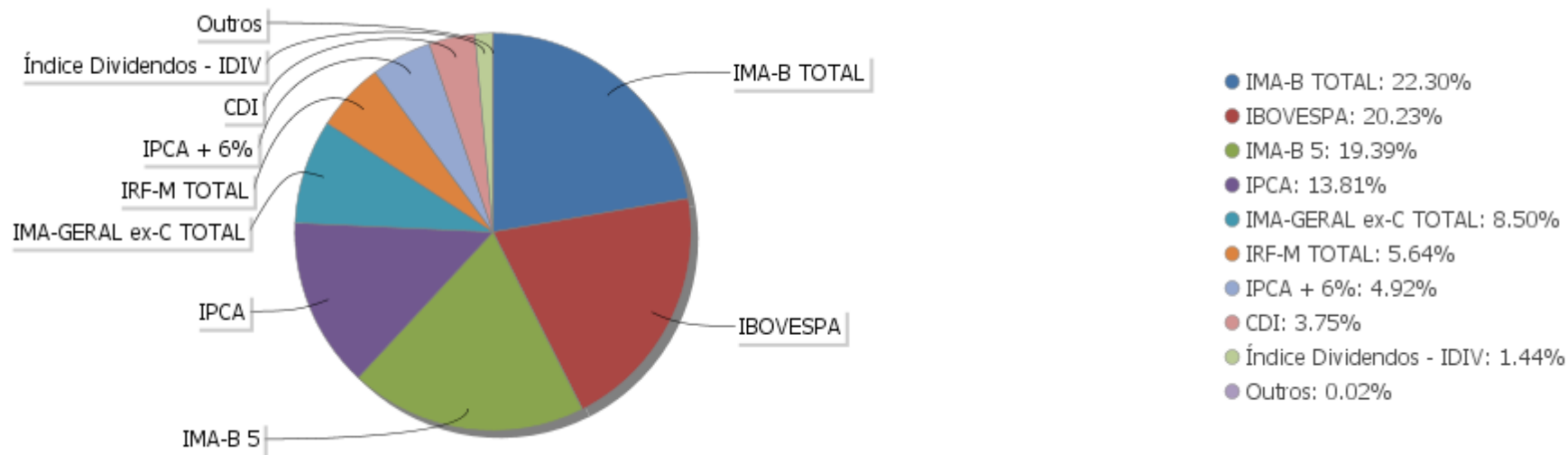
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	578.826.461,49	89,00	578.826.461,49	89,00
de 31 a 364 dias	51.274.633,58	7,88	630.101.095,07	96,88
acima de 365 dias	20.270.363,87	3,12	650.371.458,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

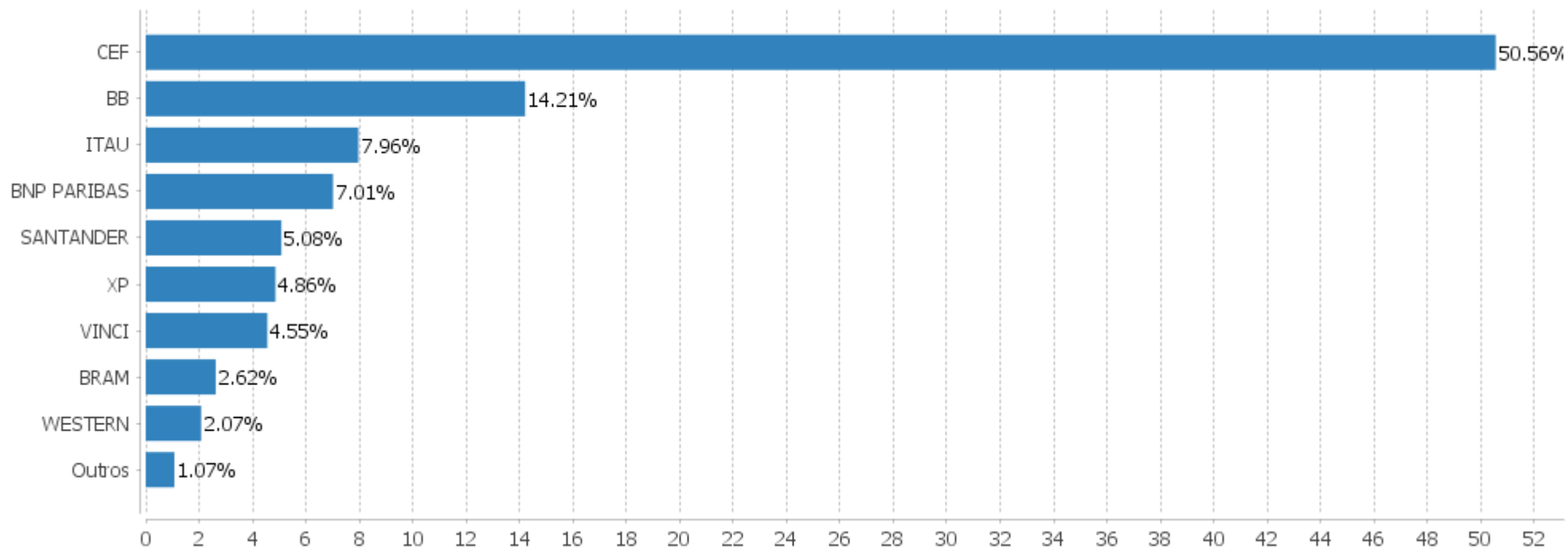


Alocação Por Estratégia



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	0,64	-0,53	-5,70	3,28	2,94								0,35
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07								2,17
p.p. indexador	-0,07	-1,19	-6,27	3,14	2,87								-1,81
2019	2,62	0,40	0,42	1,14	1,92	2,62	1,15	-0,04	2,03	2,09	-0,62	1,90	16,73
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	0,26	6,14
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

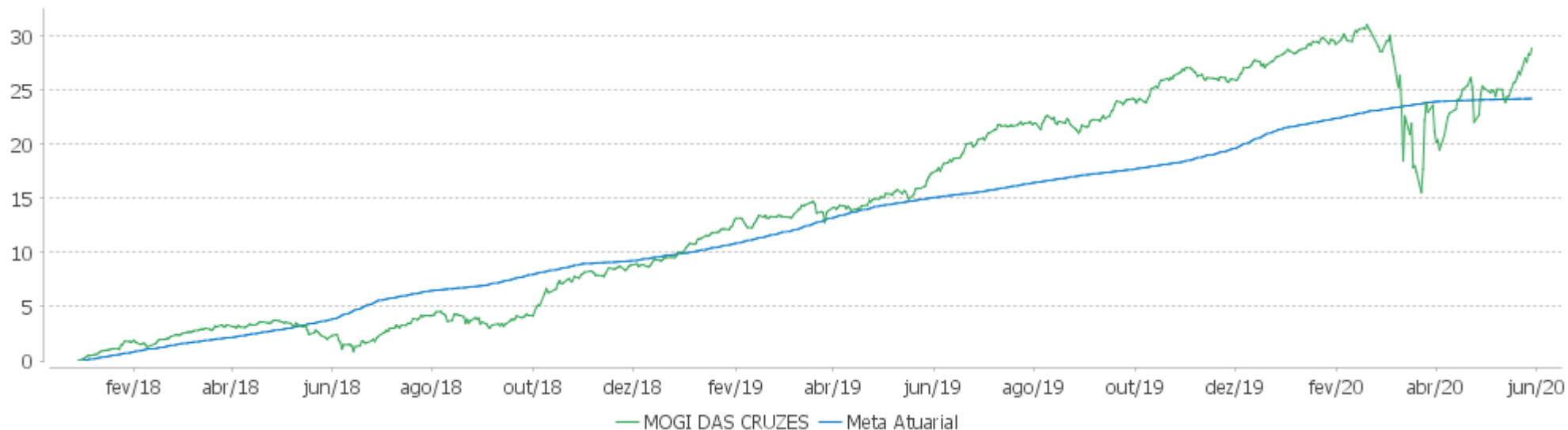
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

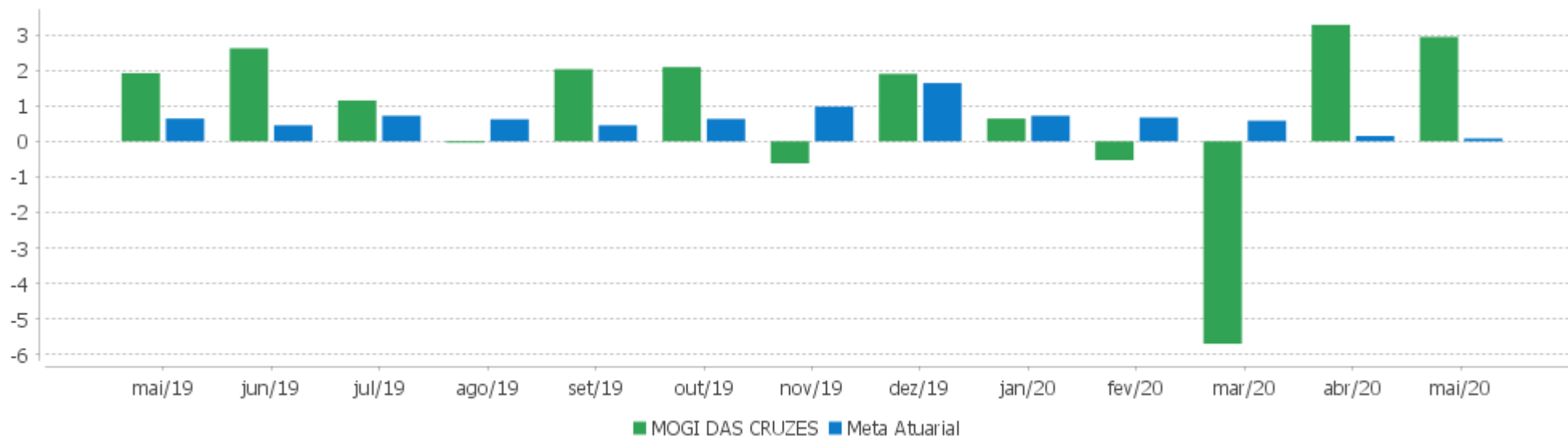
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	16	55,17	03 meses	0,25	0,78	-0,53	20,59
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	44,83	06 meses	2,26	3,84	-1,59	14,81
			12 meses	9,83	7,91	1,92	10,60
			24 meses	26,22	19,68	6,54	7,90
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,70	2020-03	Desde 29/12/2017	28,92	24,19	4,73	7,26

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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,82 -0,19	-4,48 -0,16	-1,91 -0,20	6,23 -0,45	31,21 -0,78	42,33 -1,17
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	2,90 0,78	3,35 1,32	1,38 0,57	4,80 1,51	12,21 2,75	30,60 6,67	44,37 8,27
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,02	1,92 -0,11	0,74 -0,08	3,15 -0,14	9,15 -0,31	23,37 -0,56	35,19 -0,90
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,03	2,19 -0,12	1,41 -0,07	2,60 -0,14	6,04 -0,28	13,42 -0,55	22,44 -0,85
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,01	1,99 -0,04	0,77 -0,05	3,20 -0,09	9,26 -0,20	23,45 -0,48	35,33 -0,77
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS P Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,40 -0,02	3,93 -0,11	2,42 -0,05	4,57 -0,12	11,04 -0,27	25,67 -0,48	38,26 -0,96
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,83 1,62	1,41 -1,04	0,43 -0,71	2,52 -1,68	8,26 0,11	29,72 9,62	41,51 12,06
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,03	-3,79 -0,15	-4,42 -0,10	-1,88 -0,18	6,32 -0,36	31,05 -0,94	41,84 -1,67
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,07 0,10	0,79 -0,00	-0,15 0,00	1,76 0,05	7,59 0,17	22,37 0,40	33,47 0,42
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,92 1,84	1,85 -0,37	0,63 -0,18	3,00 -0,90	8,95 0,99	30,82 11,08	42,32 11,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,38 1,76	3,85 4,01	2,37 2,99	4,46 3,48	11,99 10,11	27,82 21,20	38,17 28,50
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,03	2,19 -0,12	1,40 -0,07	2,59 -0,14	6,05 -0,27	13,53 -0,44	22,62 -0,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,02	2,22 -0,09	1,42 -0,05	2,63 -0,11	6,11 -0,21	13,55 -0,42	22,63 -0,66
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,02	-3,95 -0,32	-4,59 -0,28	-2,05 -0,35	6,15 -0,53	30,99 -1,01	42,08 -1,43
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,54 0,03	-3,89 -0,26	-4,53 -0,21	-1,96 -0,26	6,22 -0,46	31,06 -0,93	42,41 -1,10
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,57 0,05	-3,96 -0,32	-4,60 -0,28	-1,90 -0,19	6,61 -0,07	32,53 0,54	43,06 -0,45
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,54	1,82	1,22	2,17	7,84	19,42	32,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,92	1,99	1,84	1,19	5,96	12,80	22,72
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,22 92,06	0,86 56,14	0,21 23,94	1,24 64,43	4,01 82,34	10,63 92,00	19,17 95,39
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	8,58 0,02	-21,88 2,54	-15,44 0,66	-16,65 2,60	-6,18 3,74	21,52 7,64	23,65 -15,72
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	7,03 -1,54	-23,10 1,33	-19,07 -2,97	-13,70 5,55	2,77 12,70	36,75 22,88	64,70 25,33
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,80 -2,77	-25,87 -1,45	-20,77 -4,67	-20,32 -1,07			
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,50 2,50	-20,43 4,65	-16,30 2,56	-13,65 3,95	-1,18 4,33	31,96 2,42	43,26 -2,33
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	6,02 -2,55	-29,39 -4,96	-21,72 -5,62	-23,87 -4,62	-14,72 -4,80	9,14 -4,74	34,73 -4,65
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,28 -0,29	-21,79 2,63	-18,28 -2,18	-11,26 7,98	8,50 18,43		
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,10 -1,47	-20,85 3,57	-17,73 -1,64	-13,70 5,54	-1,10 8,82	33,99 20,12	
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,47 0,90	-24,56 -0,14	-22,38 -6,28	-17,04 2,20	0,33 10,25	26,59 12,72	61,91 22,53
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,82 -2,75	-25,90 -1,48	-20,82 -4,72	-20,34 -1,09	-8,74 1,18	28,96 15,08	46,25 6,88
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	6,94 -1,62	-31,07 -6,65	-26,48 -10,39	-22,01 -2,76	-2,58 7,34	17,28 3,40	32,90 -6,48
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	7,64 -0,93	-22,34 2,08	-17,48 -1,38	-15,12 4,13			
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,48 -1,08	-23,74 0,68	-15,01 1,09	-17,02 2,22	-8,97 0,96	29,31 15,44	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	5,37 2.277,97	-7,19 -467,17	-0,03 -3,14	-4,76 -248,03	10,60 217,68	16,29 140,98	38,45 191,27
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	1,17 494,60	3,67 238,51	2,79 323,80	4,64 241,62	8,21 168,51	15,61 135,13	26,24 130,56
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	8,56 -0,01	-24,49 -0,07	-16,11 -0,01	-19,19 0,06	14,53 24,45	14,14 0,27	
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES Var. IBOVESPA p.p.	3,31 -5,26	22,46 46,88	20,81 36,91	20,97 40,21	45,88 55,80	72,10 58,23	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,99	40,31	25,26	37,42	65,74		

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.	-4,58	64,74	41,36	56,67	75,66		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	5,57	41,04	33,59	37,84			
Var. IPCA + 6% p.p.	5,49	38,82	32,77	33,94			
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

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	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	3,59	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	0,80	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
Renda Variável							
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,93	6,51	14,67	19,57
SELIC	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,11
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
05/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	15.000,00	81,43079100	184,2055068000
05/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	783.000,00	0,00	4.250,68725500	184,2055068000
05/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	189.649,72	1.029,55510600	184,2055068000
05/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.877.439,94	10.192,09458500	184,2055068000
05/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	842.910,34	4.575,92372200	184,2055068000
08/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	437.000,00	0,00	2.370,48695800	184,3503077000
08/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	783.000,00	4.247,34848500	184,3503077000
08/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.472.000,00	0,00	24.258,16401300	184,3503077000
08/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	3.013.000,00	0,00	16.343,88376000	184,3503077000
18/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	22.000,00	119,29910700	184,4104334000
18/05/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.957.000,00	10.612,19782400	184,4104334000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

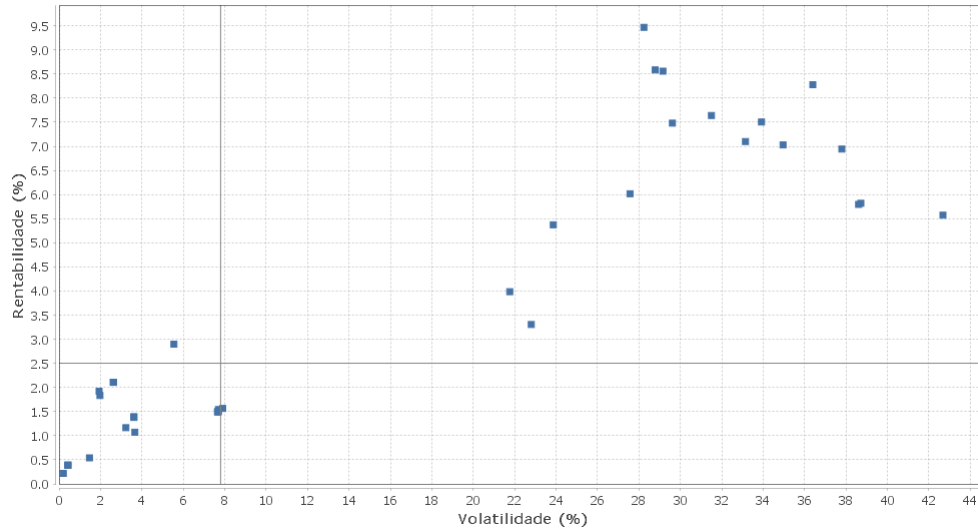
Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
--------	-------	------------	-----------------	---------------	------------

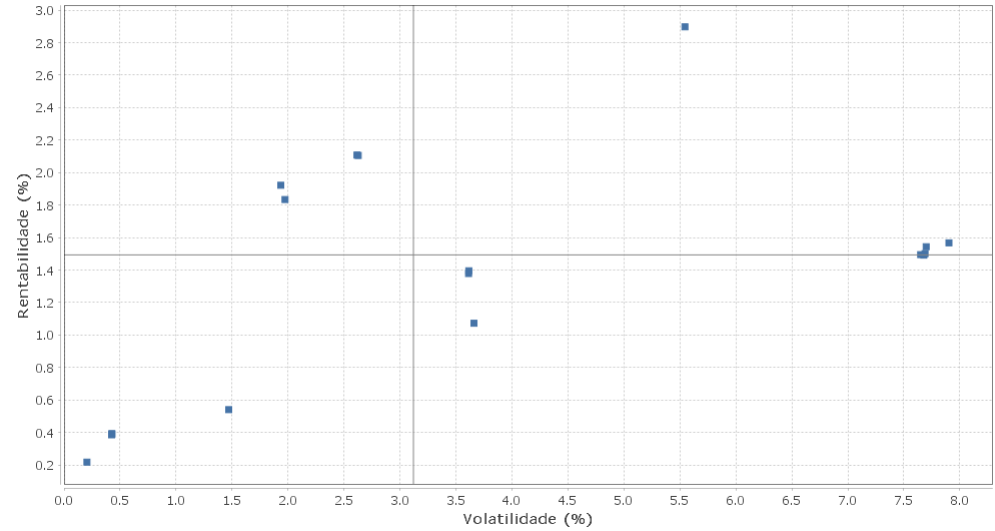
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

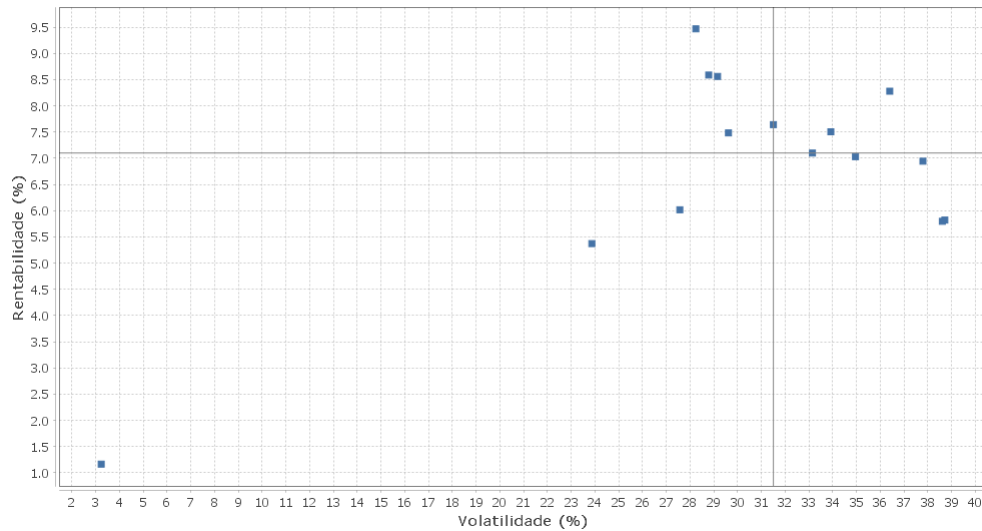
MOGI DAS CRUZES - No Mês



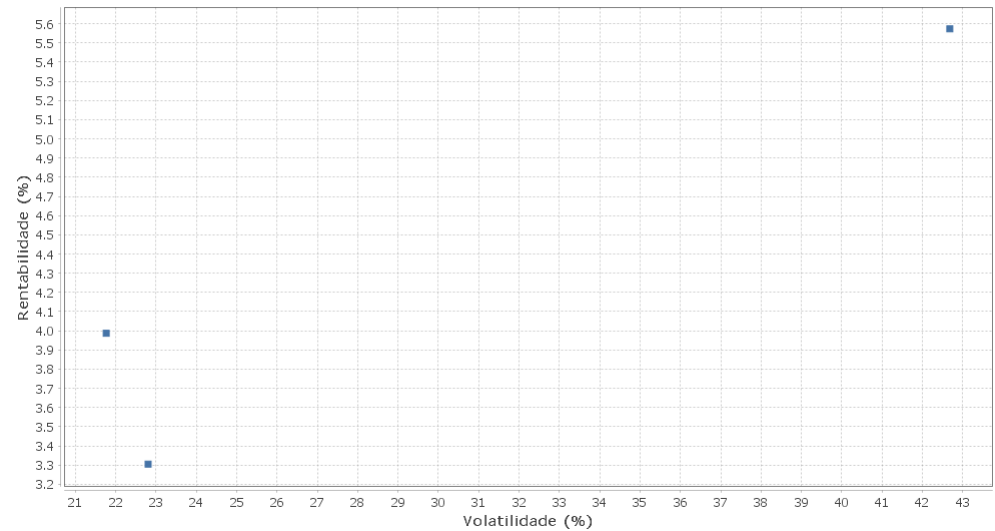
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,20	0,03	0,22	9.911.959,53	1,52
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,42	0,06	0,39	15.224,77	0,00
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,06	0,39	61.001,58	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,06	0,39	78.133,21	0,01
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,47	0,18	0,54	23.535.455,25	3,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	0,30	1,92	15.870.866,49	2,44
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,97	0,30	1,83	4.399.497,38	0,68
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,62	0,38	2,11	12.877.600,82	1,98
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,63	0,38	2,11	109.936.942,54	16,90
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	3,23	0,39	1,17	3.441.383,08	0,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,44	1,38	65.663.098,54	10,10
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS P	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,44	1,40	36.395.679,55	5,60
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	3,66	0,43	1,07	54.921.861,60	8,44
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,54	0,72	2,90	2.417.833,65	0,37
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,65	0,87	1,49	19.185.348,96	2,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	7,68	0,87	1,49	13.431.517,46	2,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	0,87	1,50	104.336.364,45	16,04
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	7,70	0,87	1,54	1.504.578,88	0,23
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	7,90	0,90	1,57	5.582.370,28	0,86
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	21,76	2,45	3,99	2.860.773,54	0,44
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	22,80	2,53	3,31	5.567.213,46	0,86
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	23,86	2,73	5,37	10.887.463,16	1,67
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	27,57	3,15	6,02	3.540.096,15	0,54
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,24	3,38	9,47	15.286.430,16	2,35
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	28,78	3,39	8,58	22.610.518,31	3,48
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	29,15	3,43	8,56	27.621.814,44	4,25
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,61	3,43	7,48	1.704.958,66	0,26
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	31,50	3,63	7,64	8.545.897,90	1,31
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	33,15	3,78	7,10	11.809.896,73	1,82
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	33,92	3,88	7,50	9.280.254,18	1,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	34,95	3,96	7,03	8.149.231,70	1,25
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	36,40	4,17	8,28	1.307.735,03	0,20
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	37,79	4,25	6,94	14.030.932,96	2,16
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	38,61	4,28	5,80	7.000.125,95	1,08
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	38,71	4,29	5,82	684.513,15	0,11
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	42,68	4,69	5,57	15.916.885,44	2,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

- Referente ao mês de maio de 2020, vale observar que o Instituto está com 23,53% do patrimônio líquido do fundo ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (Art. 9 A, Inciso II), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Salientamos também que de acordo com informações provenientes da Nota Técnica nº 12/2017/CGAI/SRPPS/SPREV-ME, versão 09 de 17/09/2019, mais especificamente a questão de número 59, existe o entendimento de que para a verificação do limite máximo de alocação no segmento de investimentos no exterior, dispostos no art. 9º-A, considera-se o patrimônio líquido do fundo constituído no exterior;
- No final do respectivo mês, abril de 2020, os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 15,98% dos recursos totais do Instituto, alocação esta superior ao limite máximos estipulado em Política de Investimentos.