



**LDB**  
EMPRESAS

**HORTOLÂNDIA**  
ABRIL 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 01.06.2020.

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

86,18%

## Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,54	0,72	-0,47	34.487.269,79	6,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	20,82	2,12	-10,38	15.537.535,45	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	1,43	0,96	1,54	35.001.994,30	6,41
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>7,28</b>	<b>1,07</b>	<b>-1,61</b>	<b>85.026.799,54</b>	<b>15,58</b>

## 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	0,53	0,41	1,79	57.837.428,61	10,60	7.168.032.689,23	0,81
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	12,26	1,30	-5,12	59.286.557,87	10,86	5.412.184.320,85	1,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,97	0,43	0,02	57.529.382,08	10,54	8.182.089.077,85	0,70
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	5,78	1,13	2,50	59.639.756,28	10,93	16.130.391.856,09	0,37
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	6,01	0,91	-0,28	46.000.707,75	8,43	10.512.346.440,60	0,44
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	6,00	1,11	2,43	49.162.127,02	9,01	11.368.843.034,79	0,43
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>5,44</b>	<b>0,88</b>	<b>0,28</b>	<b>329.455.959,61</b>	<b>60,37</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
QUELUZ	ORLA	BRA1 FI RENDA FIXA	56,99	-5,88	-25,55	723.116,57	0,13	17.337.596,08	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,98	0,14	1,28	46.431.045,21	8,51	5.079.848.328,78	0,91
ROMA	FOCO	FI RENDA FIXA MONTE CARLO INSTIT IMA B	20,00	-0,11	2,43	1.291.680,07	0,24	136.359.054,30	0,95
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	7,47	0,34	-4,47	3.661.107,48	0,67	69.369.602,86	5,28
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,93</b>	<b>0,06</b>	<b>0,38</b>	<b>52.106.949,33</b>	<b>9,55</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,50	-0,26	-2,32	1.881.927,53	0,34	74.507.244,57	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	101,05	-0,18	-1,15	1.839.413,92	0,34	84.811.796,40	2,17
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	152,81	0,00	-83,89	0,00	0,00	0,00	
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	152,81	0,00	-83,89	0,00	0,00	4.957,59	0,00
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	149,64	0,00	-83,89	0,00	0,00	7.125,27	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>45,99</b>	<b>-0,22</b>	<b>-1,86</b>	<b>3.721.341,45</b>	<b>0,68</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>5,29</b>	<b>0,81</b>	<b>-0,08</b>	<b>470.311.049,93</b>	<b>86,18</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,82%

## 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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	43,86	11,36	-31,54	14.976.942,01	2,74	699.654.427,07	2,14
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	44,95	11,39	-30,61	16.761.423,37	3,07	1.013.500.715,68	1,65
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	38,93	10,92	-28,05	12.744.055,96	2,34	235.257.525,45	5,42
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	41,69	11,03	-32,47	20.078.270,60	3,68	2.886.370.474,18	0,70
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>42,10</b>	<b>11,18</b>	<b>-30,93</b>	<b>64.560.691,94</b>	<b>11,83</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	8,33	-0,33	7,12	237.516,43	0,04	1.682.091,96	14,12
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>8,33</b>	<b>-0,33</b>	<b>7,08</b>	<b>237.516,43</b>	<b>0,04</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	166,01	-81,05	-81,06	1.378.207,35	0,25	50.681.300,80	2,72
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	51,69	-29,15	-38,48	394,23	0,00	139.110,11	0,28
QUELUZ	BNY MELLON	ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	55,16	20,90	20,31	1.551.612,03	0,28	23.681.869,25	6,55
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>107,30</b>	<b>-65,76</b>	<b>-65,79</b>	<b>2.930.213,61</b>	<b>0,54</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	231,69	-3,02	-28,17	2.428.000,00	0,44	694.567.034,00	0,35
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	51,57	0,40	-1,80	2.955.572,62	0,54	31.376.185,18	9,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	29,03	3,98	-21,53	299.800,56	0,05	2.512.024.970,39	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	12,04	-0,14	-0,59	2.032.336,32	0,37	147.502.591,77	1,38

**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 IV, Alínea b</b>	<b>30,23</b>	<b>-0,71</b>	<b>-9,16</b>	<b>7.715.709,50</b>	<b>1,41</b>		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	34,45	1,08	-31,44	75.444.131,48	13,82		
		<b>Total</b>				<b>545.755.181,41</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 a	Títulos do Tesouro Nacional	85.026.799,54	15,58	5,00	15,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	329.455.959,61	60,37	10,00	52,50	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.106.949,33	9,55	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.721.341,45	0,68	0,00	0,50	3,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>470.311.049,93</b>	<b>86,18</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	64.560.691,94	11,83	0,00	14,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	237.516,43	0,04	0,00	0,50	3,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	2.930.213,61	0,54	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	7.715.709,50	1,41	0,00	1,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>75.444.131,48</b>	<b>13,82</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 a % do CDI	1,07 377,15	-1,61 -124,09	-2,11 -229,20	-0,67 -32,46	10,39 200,03	901.019,46	-1.411.521,73
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,88 308,22	0,28 21,74	-0,26 -28,04	0,53 25,65	9,15 176,22	2.868.217,17	836.047,29
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,06 21,74	0,38 28,95	0,07 7,07	0,12 5,96	3,95 76,11	32.249,55	195.340,17
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,22 -76,67	-1,86 -142,90	-1,50 -163,26	-2,42 -117,10	-6,14 -118,35	-8.147,57	-70.435,56
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	11,18 0,92	-30,93 -0,55	-32,56 -3,33	-23,91 1,01	-9,21 7,24	6.490.125,28	-28.917.287,70
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,33 -10,58	7,08 37,46	-0,69 28,54	5,23 30,15	3,34 19,79	-779,03	15.694,67
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-65,76 -76,01	-65,79 -35,41	-65,77 -36,54	-65,27 -40,36	-68,16 -51,72	-5.626.931,99	-5.635.690,39
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,71 -10,96	-9,16 21,23	-6,38 22,85	-6,10 18,82	-4,39 12,05	-55.059,53	-954.525,56
						4.600.693,34	-35.942.378,81

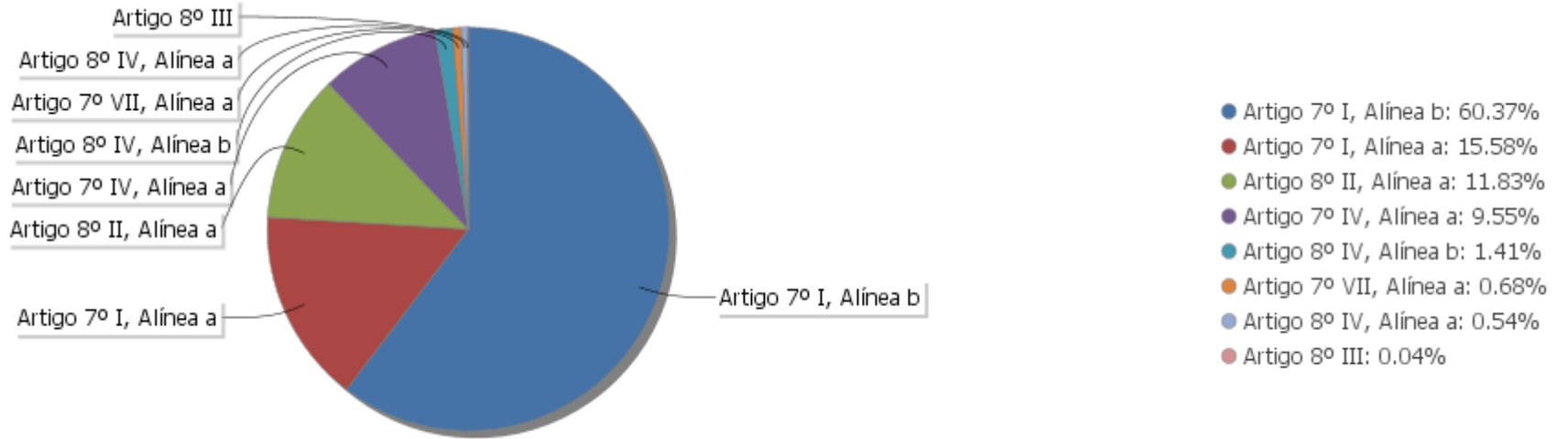
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	425.675.976,45	78,00	425.675.976,45	78,00
de 31 a 364 dias	55.080.659,13	10,09	480.756.635,58	88,09
acima de 365 dias	64.998.545,83	11,91	545.755.181,41	100,00

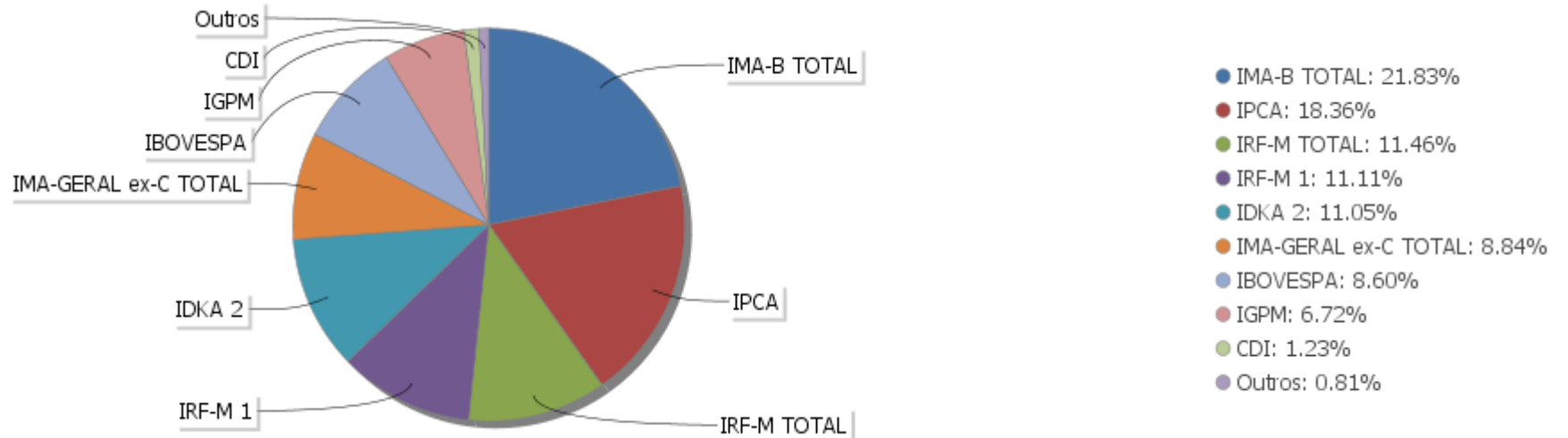


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

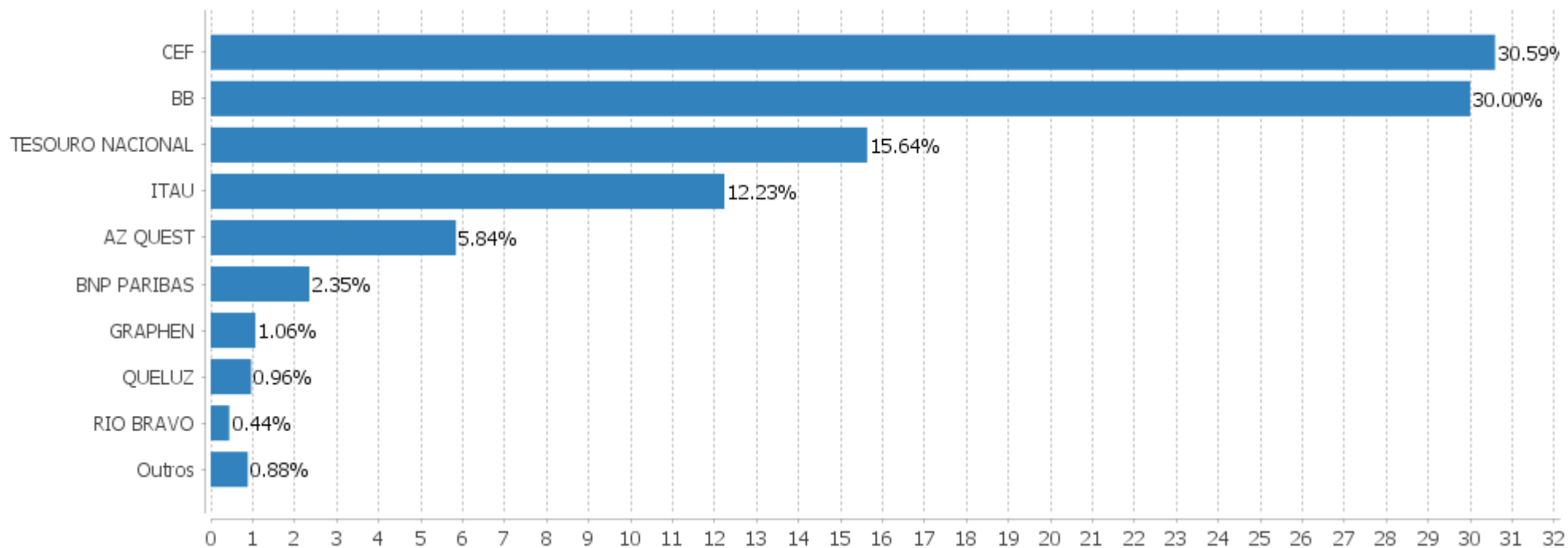


Alocação Por Estratégia



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	0,74	-0,95	-6,76	0,85									-6,17
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14									2,10
p.p. indexador	0,03	-1,61	-7,33	0,71									-8,27
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
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	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

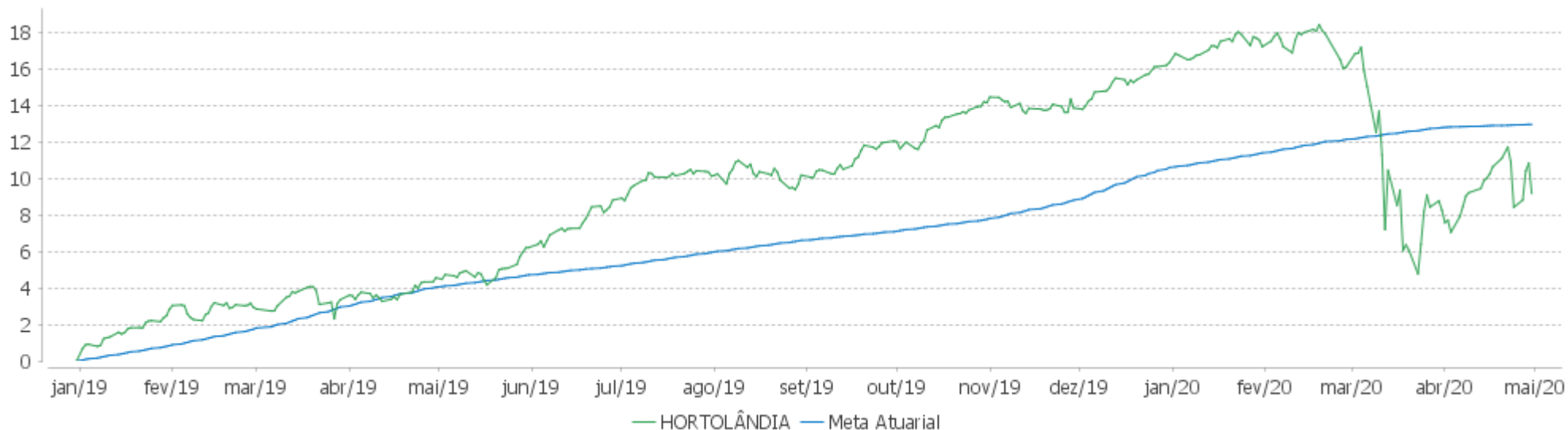
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

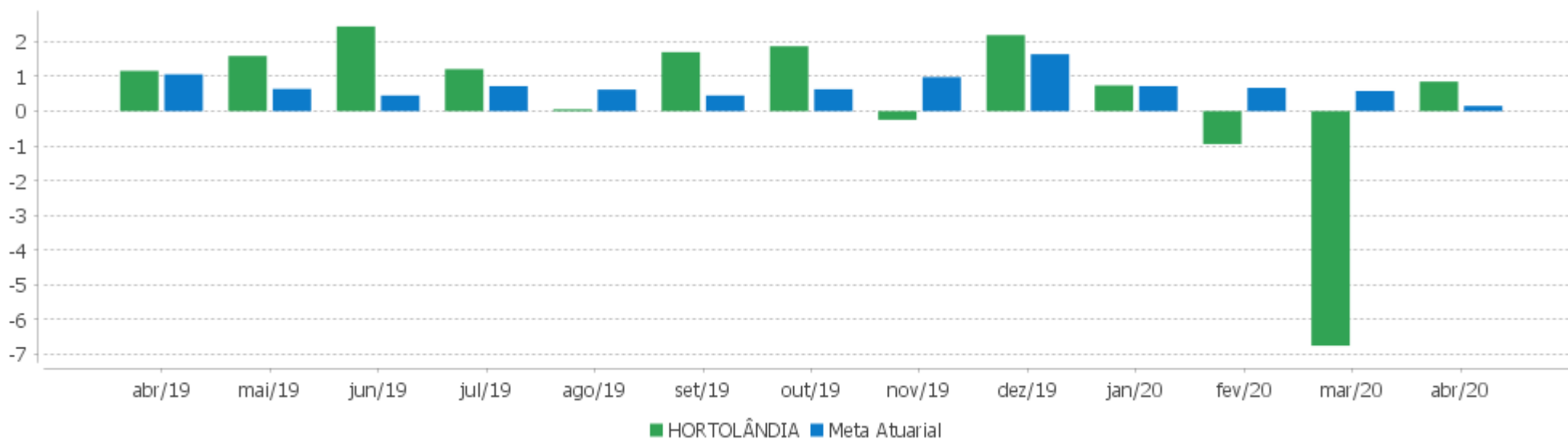
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	10	62,50	03 meses	-6,86	1,38	-8,24	17,53
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	37,50	06 meses	-4,36	4,79	-9,14	12,50
			12 meses	4,42	8,52	-4,10	9,06
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,83	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03	Desde 31/12/2018	9,17	12,91	-3,74	8,10

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
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,72 -0,60	-0,47 4,61	-1,28 4,04	0,05 5,60	11,62 2,68	24,39 -1,53	40,09 0,41
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,12 0,81	-10,38 -5,30	-10,24 -4,92	-11,63 -6,07	7,96 -0,97	29,15 3,24	41,88 2,20
NTN-C 010421 Var. IGPM p.p.	0,96 0,16	1,54 -0,96	1,02 -0,99	4,20 -0,76	10,30 3,61	25,06 9,14	40,55 22,43
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91 0,07	-0,28 -0,10	-0,76 -0,09	-0,26 -0,29	8,60 0,26	19,45 0,41	31,58 -0,29
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,41 -0,03	1,79 -0,09	1,37 -0,07	2,51 -0,14	6,31 -0,29	13,19 -0,53	23,04 -0,85
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	1,11 1,42	2,43 2,22	1,60 1,59	2,52 0,63	13,47 11,07	24,61 17,15	36,68 26,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,43 -0,15	0,02 -0,55	-0,44 -0,47	1,13 -0,67	7,34 -1,27	17,02 -1,82	30,50 -2,96
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,02	-5,12 -0,04	-5,36 -0,04	-5,65 -0,09	8,71 -0,22	25,32 -0,60	38,67 -1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,13 -0,02	2,50 -0,09	1,65 -0,05	2,62 -0,13	11,40 -0,29	21,56 -0,51	36,77 -0,92
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-5,88 -7,20	-25,55 -20,47	-25,20 -19,87	-47,94 -42,39	-70,36 -79,29	-67,92 -93,83	-61,46 -101,14
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 0,45	1,28 1,06	0,93 0,92	1,98 0,09	9,19 6,79	18,37 10,91	30,21 19,78
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,34 -0,97	-4,47 0,61	-4,70 0,62	-4,98 0,57	2,31 -6,62	-17,09 -43,00	
FI RENDA FIXA MONTE CARLO INSTIT IMA B Var. IMA-B 5 p.p.	-0,11 -0,60	2,43 2,52	2,38 3,02	1,74 0,88	-17,75 -26,42	-12,65 -32,12	3,99 -29,39
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,18 -61,82	-1,15 -88,25	-0,61 -66,51	-1,51 -72,99	-8,43 -162,41	-12,84 -108,25	-16,17 -77,29
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI	0,00 0,00	-83,89 -6.453,91	-74,30 -8.077,38	-90,81 -4.395,04	-96,39 -1.856,34	-98,68 -831,65	
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI	0,00 0,00	-83,89 -6.453,91	-74,30 -8.077,37	-90,81 -4.395,04	-96,39 -1.856,34	-98,59 -830,95	
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	-83,89	-74,30	-90,81	-96,39	-98,51	-99,33

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	0,00	-6.453,91	-8.077,38	-4.395,04	-1.856,34	-830,28	-474,65
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	-0,26	-2,32	-2,22	-2,92	-2,84	1.177,36	
% do CDI	-91,18	-178,82	-241,29	-141,22	-54,75	9.922,89	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	10,92	-28,05	-27,50	-22,83	-12,03	2,31	14,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,66	2,33	1,74	2,09	4,42	8,82	-8,62
AZ QUEST ACOES FIC FIA	11,36	-31,54	-34,06	-26,84	-16,84	-7,32	29,80
Var. IBOVESPA p.p.	1,11	-1,16	-4,83	-1,93	-0,39	-0,80	6,71
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	11,39	-30,61	-34,95	-19,91	-0,36	13,81	59,50
Var. IBOVESPA p.p.	1,13	-0,23	-5,72	5,00	16,09	20,32	36,41
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,03	-32,47	-32,34	-25,59	-9,53	3,07	
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-0,33	7,12	-0,65	5,28	3,38	-94,58	-94,03
% do CDI	-114,73	547,83	-70,43	255,32	65,17	-797,15	-449,31
BRCR11	3,42	-21,53	-19,66	-0,13	-0,47	-10,18	-7,93
Var. IBOVESPA p.p.	-6,84	8,86	9,57	24,79	15,97	-3,67	-31,02
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	-0,14	-0,59	-0,42	2,31	-11,71	-19,30	-21,37
Var. IFIX p.p.	-4,53	17,98	14,97	9,06	-15,50	-30,70	-49,26
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	-3,64	-28,17	-19,61	-13,72	-90,24	-89,40	
% do CDI	-1.275,94	-2.166,74	-2.131,72	-663,87	-1.738,00	-753,51	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	0,40	-1,80	-2,34	-12,60	-11,59	-3,81	
Var. IFIX p.p.	-3,99	16,78	13,05	-5,85	-15,38	-15,20	
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	-81,05	-81,06	-81,05	-81,07	-81,02	-80,90	-85,06
Var. IPCA + 6% p.p.	-81,20	-83,19	-82,46	-85,90	-89,59	-101,62	-116,49
ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	20,90	20,31	20,53	34,14	-20,10	-20,33	
Var. IPCA + 6% p.p.	20,75	18,17	19,12	29,31	-28,66	-41,05	
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	-29,15	-38,50	-34,48	-59,22	-65,62	-98,66	-99,24
% do CDI	-10.231,54	-2.961,42	-3.748,52	-2.866,22	-1.263,81	-831,50	-474,24
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

## 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	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,95	6,69	15,93	18,12
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
<b>Meta Atuarial</b>							
IPCA + 4%	0,00	1,51	0,95	3,86	6,51	16,21	24,16

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,08	1,82	1,18	4,34	7,54	18,45	27,76
IPCA + 5,5%	0,11	1,98	1,29	4,59	8,05	19,58	29,59
IPCA + 5,89%	0,14	2,10	1,38	4,78	8,45	20,46	31,02
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43
INPC + 4%	0,08	1,60	1,06	4,05	6,57	16,43	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

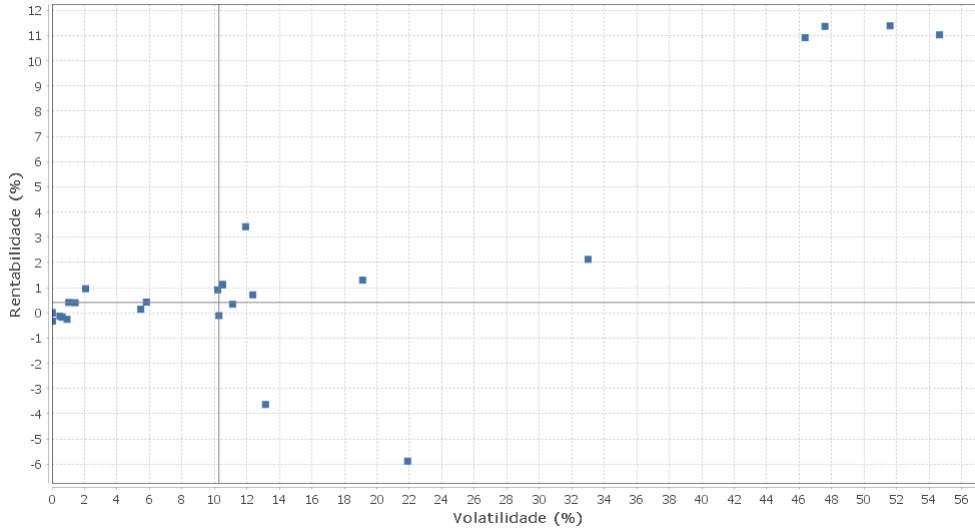
## Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
01/04/2020	BB PREV IMAB TPB	1.851.841,23	0,00	322.706,50238000	5,7384689070
09/04/2020	BB PREV IMAB TPB	4.740.000,00	0,00	821.076,50066100	5,7729090970
09/04/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1.000.000,00	0,00	448.698,10245500	2,2286700000
15/04/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	80.000,00	29.904,10199300	2,6752182700
23/04/2020	BB PREV IMAB TPB	320.000,00	0,00	54.064,07801800	5,9189023790
28/04/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	2.740.000,00	1.022.477,52877400	2,6797654940
28/04/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	180.000,00	67.170,05663500	2,6797654940

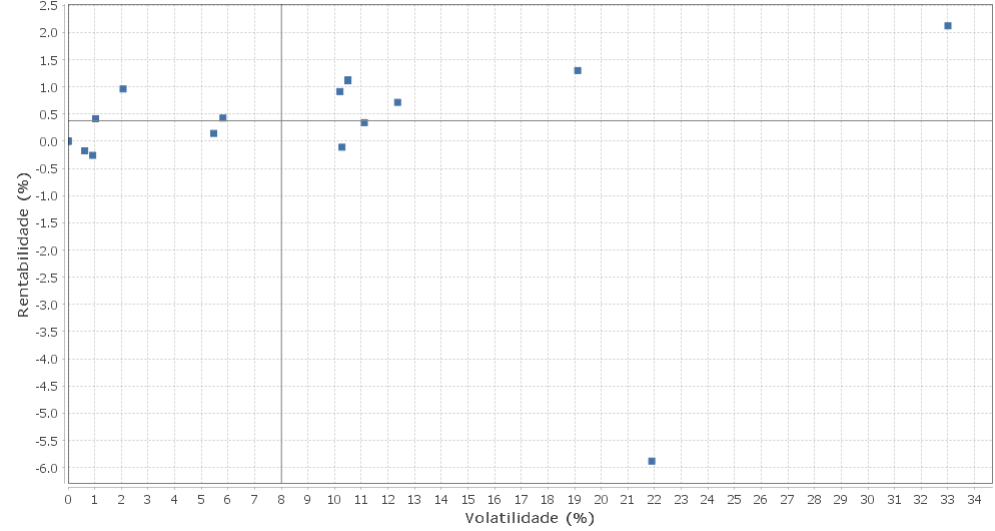
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

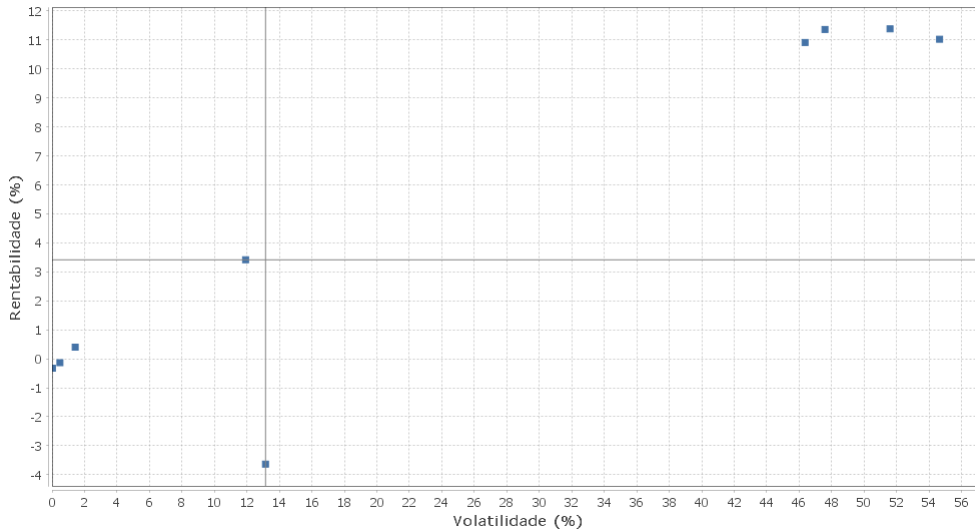
HORTOLÂNDIA - No Mês



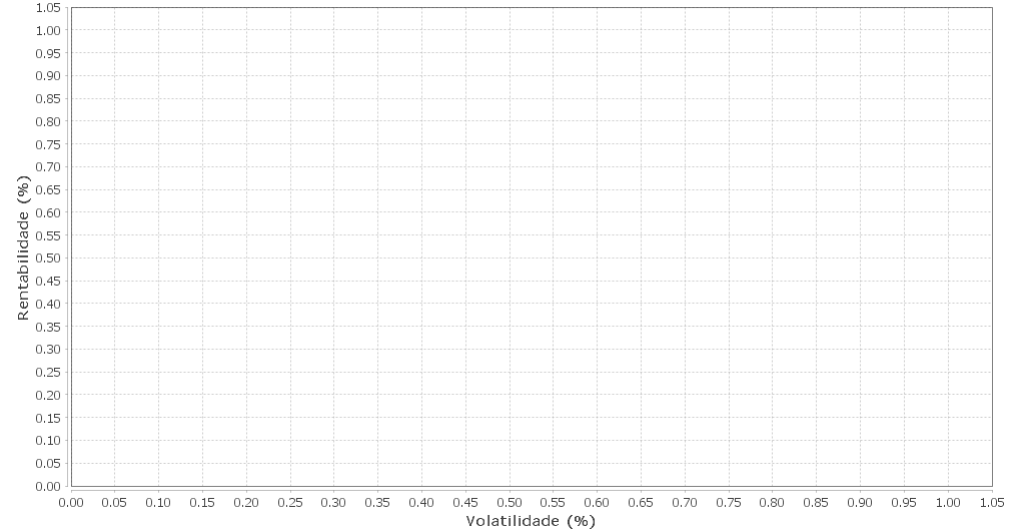
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,02	-0,01	-0,33	237.516,43	0,04
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,48	0,04	-0,14	2.032.336,32	0,37
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,63	0,06	-0,18	1.839.413,92	0,34
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	0,92	0,08	-0,26	1.881.927,53	0,34
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,13	0,41	57.837.428,61	10,60
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,42	0,17	0,40	2.955.572,62	0,54
NTN-C 010421	Artigo 7º I, Alínea a	2,07	0,26	0,96	35.001.994,30	6,41
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	5,46	0,57	0,14	46.431.045,21	8,51
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,81	0,62	0,43	57.529.382,08	10,54
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	1,10	0,91	46.000.707,75	8,43
FI RENDA FIXA MONTE CARLO INSTIT IMA B	Artigo 7º IV, Alínea a	10,27	1,06	-0,11	1.291.680,07	0,24
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,49	1,14	1,11	49.162.127,02	9,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,50	1,14	1,13	59.639.756,28	10,93
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	11,11	1,17	0,34	3.661.107,48	0,67
BRCR11	Artigo 8º IV, Alínea b	11,92	1,40	3,42	299.800,56	0,05
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	12,36	1,32	0,72	34.487.269,79	6,32
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	13,15	1,18	-3,64	2.428.000,00	0,44
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	19,12	2,05	1,30	59.286.557,87	10,86
BRA1 FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	21,90	1,97	-5,88	723.116,57	0,13
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	33,01	3,52	2,12	15.537.535,45	2,85
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	46,36	5,32	10,92	12.744.055,96	2,34
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,59	5,47	11,36	14.976.942,01	2,74
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	51,59	5,88	11,39	16.761.423,37	3,07
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	54,64	6,18	11,03	20.078.270,60	3,68

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

-Referente ao mês de abril de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 14,12% do patrimônio líquido do fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V (Art. 8, Inciso III), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 6,55% do patrimônio líquido do fundo ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 9,42% do patrimônio líquido do fundo VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII (Art. 8, Inciso IV, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;