



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
JUNHO 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 17.07.2020.

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 84,97%

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	8,58	1,26	3,98	36.030.441,25	6,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	21,14	2,79	-7,33	15.683.134,19	2,75
TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	1,48	2,53	5,70	36.433.709,27	6,40
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,34	2,05	2,44	88.147.284,71	15,48

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	0,53	0,26	2,45	54.665.413,69	9,60	7.792.694.548,07	0,70
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	67.034.032,44	11,77	5.526.503.185,82	1,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,01	1,18	3,12	59.711.532,88	10,48	7.740.606.629,29	0,77
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	0,77	4,73	60.936.139,52	10,70	17.164.831.993,69	0,36
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	1,75	46.934.985,47	8,24	10.783.491.196,95	0,44
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	50.213.543,45	8,82	12.211.119.756,17	0,41
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		5,48	1,02	2,62	339.495.647,45	59,61			

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	55,58	0,19	-20,09	683.967,80	0,12	16.398.956,82	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,44	2,27	46.885.448,48	8,23	5.170.951.886,47	0,91
ROMA	FOCO	FI RENDA FIXA MONTE CARLO INSTIT IMA B	14,71	0,38	2,50	1.292.633,08	0,23	136.878.038,09	0,94
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	19,69	0,89	-3,16	3.711.417,57	0,65	70.322.863,61	5,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,88	0,46	1,45	52.573.466,93	9,23		
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	2,46	-0,21	-2,96	1.869.729,73	0,33	74.024.321,09	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	87,52	-0,21	-1,55	1.831.845,17	0,32	84.462.815,74	2,17
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	151,78	0,00	-83,89	0,00	0,00	0,00	
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	151,78	0,00	-83,89	0,00	0,00	4.957,59	0,00
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	148,90	0,00	-83,89	0,00	0,00	7.125,27	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			36,48	-0,21	-2,38	3.701.574,90	0,65		
Renda Fixa			5,32	1,14	2,41	483.917.973,99	84,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,03%

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	44,55	9,88	-17,76	17.991.622,25	3,16	806.010.588,17	2,23
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,57	8,63	-20,26	19.262.739,56	3,38	1.154.678.354,43	1,67
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	39,99	7,79	-15,79	14.915.827,57	2,62	267.384.087,20	5,58
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	42,89	9,28	-22,25	23.117.430,35	4,06	3.271.734.214,80	0,71
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,95	8,96	-19,46	75.287.619,73	13,22		

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	8,31	-0,34	6,41	235.943,79	0,04	1.670.954,26	14,12
Sub-total Artigo 8º III			8,31	-0,34	6,37	235.943,79	0,04		

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	243,85	-83,41	-96,86	228.474,50	0,04	8.392.454,80	2,72
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	57,56	-5,62	-25,85	474,95	0,00	118.740,01	0,40
QUELUZ	BNY MELLON	ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	21,89	-0,16	19,94	1.546.862,11	0,27	28.543.996,54	5,42
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			117,79	-39,33	-79,27	1.775.811,56	0,31		

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	32,99	16,17	-11,83	2.980.000,00	0,52	433.660.805,03	0,69
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	51,63	0,29	0,36	3.020.612,91	0,53	31.376.185,18	9,63
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	28,53	2,48	-21,49	299.962,86	0,05	2.519.275.036,94	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	3,99	-0,16	-0,91	2.025.932,44	0,36	181.485.441,09	1,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	30,72	5,42	-1,50	8.326.508,21	1,46		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	35,30	6,82	-22,16	85.625.883,29	15,03		
		Total				569.543.857,28	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	88.147.284,71	15,48	5,00	15,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	339.495.647,45	59,61	10,00	52,50	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.573.466,93	9,23	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.701.574,90	0,65	0,00	0,50	3,00	5,00
	Total Renda Fixa	483.917.973,99	84,97				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	75.287.619,73	13,22	0,00	14,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	235.943,79	0,04	0,00	0,50	3,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.775.811,56	0,31	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	8.326.508,21	1,46	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	85.625.883,29	15,03				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

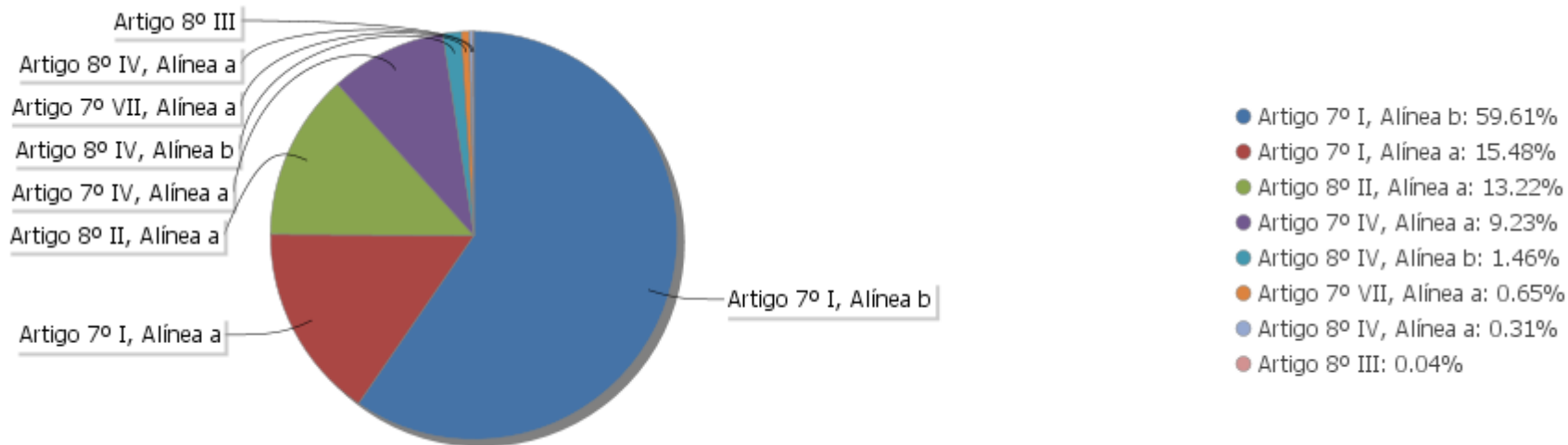
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	2,05 965,78	2,44 138,80	5,23 712,18	2,44 138,80	9,08 197,35	1.771.237,96	2.071.738,01
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,02 482,11	2,62 149,29	3,23 439,35	2,62 149,29	7,53 163,64	3.443.702,14	8.595.735,13
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,46 218,16	1,45 82,80	1,13 154,45	1,45 82,80	1,42 30,83	242.616,27	753.615,39
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,21 -100,61	-2,38 -135,60	-0,75 -101,85	-2,38 -135,60	-6,71 -145,83	-7.924,58	-90.202,11
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,96 0,20	-19,46 -1,66	29,65 -0,53	-19,46 -1,66	-0,96 4,89	6.189.127,18	-18.190.359,91
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,34 -9,09	6,37 24,17	-0,99 -31,17	6,37 24,17	0,98 6,84	-793,94	14.122,03
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-39,33 -48,08	-79,27 -61,46	-79,25 -109,43	-79,27 -61,46	-78,93 -73,07	-1.150.979,59	-6.790.092,44
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	5,42 -3,34	-1,50 16,30	7,66 -22,52	-1,50 16,30	1,41 7,27	427.846,09	-306.935,29
						10.914.831,53	-13.942.379,19

Análise de Liquidez

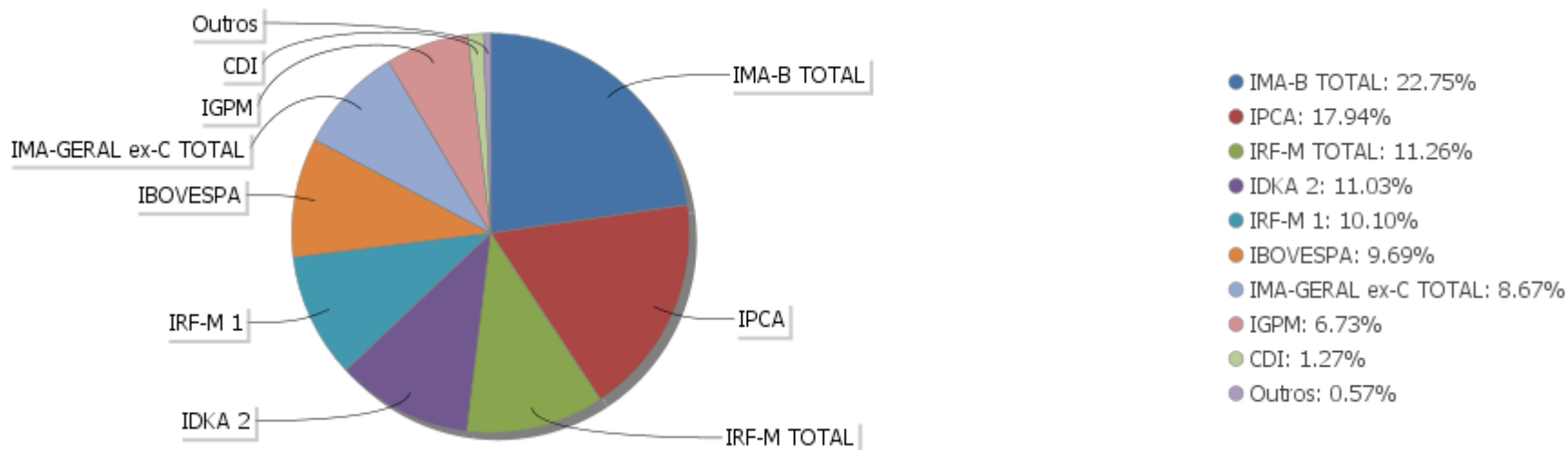
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	442.694.373,74	77,73	442.694.373,74	77,73
de 31 a 364 dias	59.551.614,57	10,46	502.245.988,31	88,18
acima de 365 dias	67.297.868,97	11,82	569.543.857,28	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

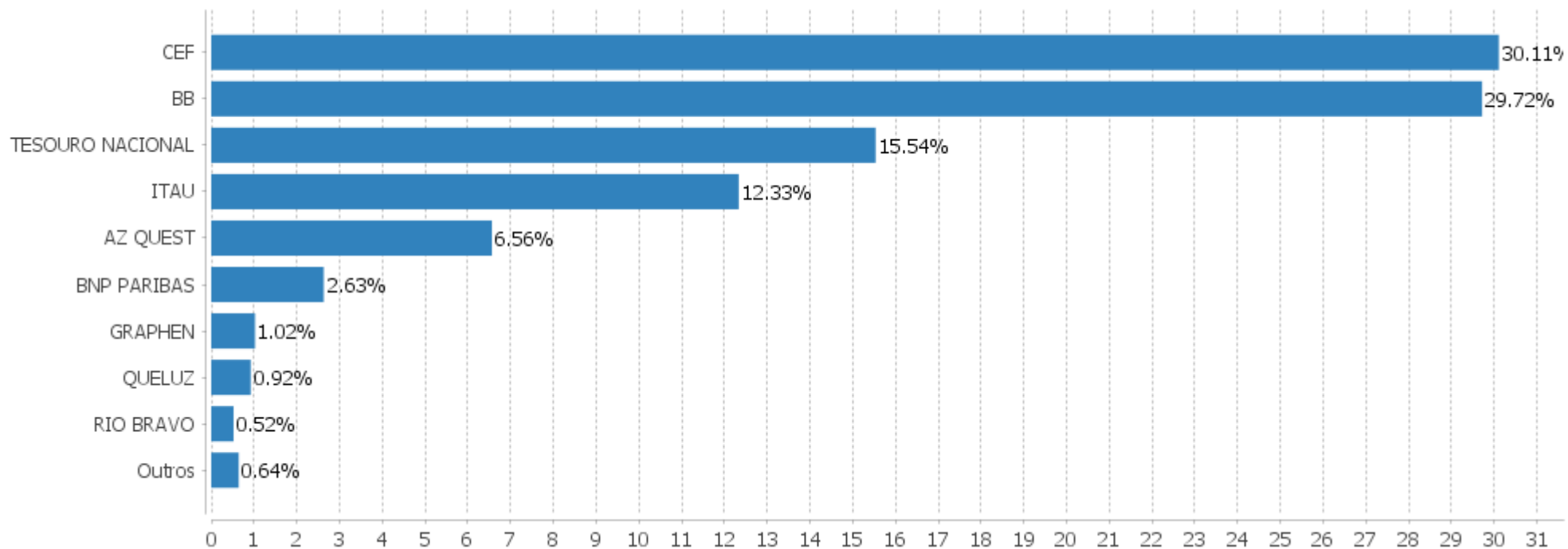


Alocação Por Estratégia



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	2,01	1,95							-2,41
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,92
p.p. indexador	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21							-5,34
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

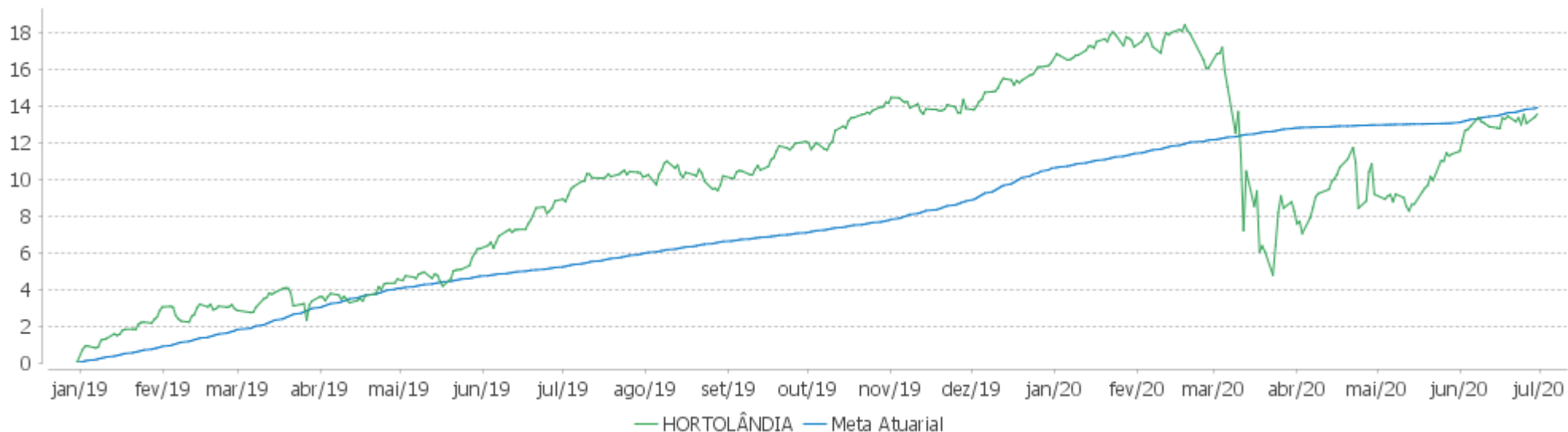
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

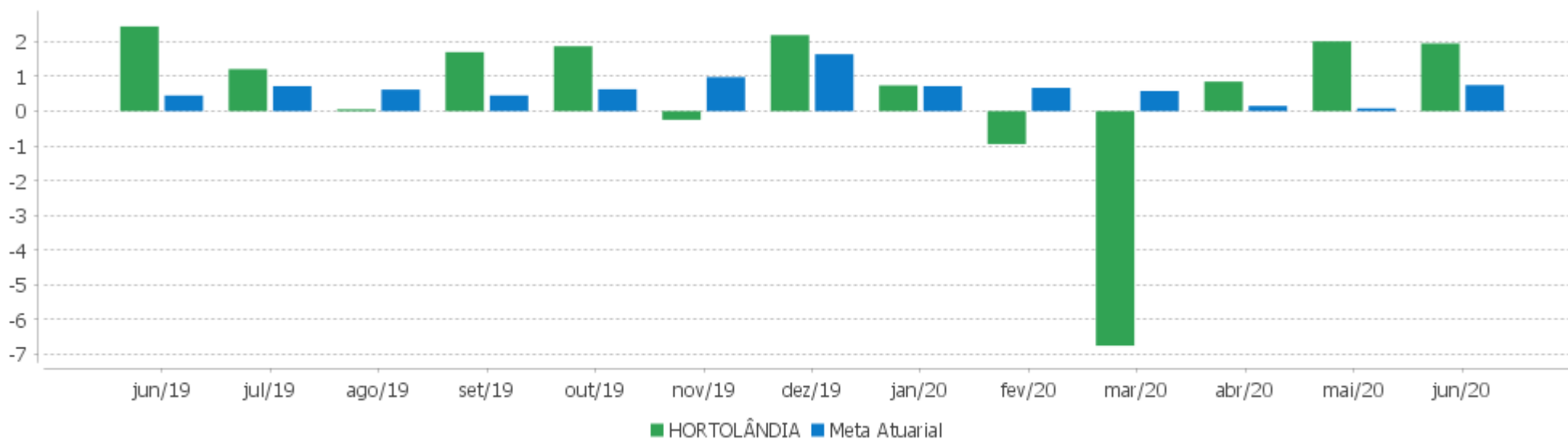
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	66,67	03 meses	4,89	0,95	3,93	8,50
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	33,33	06 meses	-2,41	2,92	-5,34	12,72
			12 meses	4,36	8,22	-3,86	9,18
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,83	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03	Desde 31/12/2018	13,54	13,82	-0,28	7,83

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	1,75 0,04	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	4,63 4,53	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,03	2,45 -0,14	1,06 -0,09	2,45 -0,14	5,71 -0,30	13,15 -0,52	21,70 -0,85
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,18 0,19	3,12 -0,23	3,54 0,19	3,12 -0,23	8,19 -0,58	21,36 -1,81	33,16 -2,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,03	-1,75 -0,08	4,90 -0,06	-1,75 -0,08	4,74 -0,20	34,48 -0,65	45,12 -1,09
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,77 -0,02	4,73 -0,13	3,33 -0,06	4,73 -0,13	9,54 -0,27	26,59 -0,49	37,48 -0,96
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,79 0,74	-7,33 -5,67	5,59 0,63	-7,33 -5,67	0,13 -4,82	42,49 7,36	51,24 5,04
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,79	3,98 5,64	5,22 0,26	3,98 5,64	10,54 5,59	34,38 -0,75	46,64 0,44
NTN-C 010421 Var. IGPM p.p.	2,53 0,97	5,70 1,31	5,09 2,43	5,70 1,31	11,98 4,66	27,67 13,37	48,49 26,28
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -1,85	-20,09 -18,43	1,02 -3,94	-20,09 -18,43	-68,43 -73,38	-65,89 -101,02	-58,91 -105,12
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,44 0,18	2,27 2,17	1,12 1,55	2,27 2,17	5,62 3,49	19,25 13,67	31,68 21,48
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 -1,15	-3,16 -1,50	1,72 -3,24	-3,16 -1,50	-0,25 -5,19	-13,67 -48,80	
FI RENDA FIXA MONTE CARLO INSTIT IMA B Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,74	2,50 -0,66	-0,04 -3,80	2,50 -0,66	-4,72 -13,53	-12,42 -37,18	-2,89 -39,79
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,21 -99,99	-1,55 -88,57	-0,59 -79,87	-1,55 -88,57	-8,44 -183,44	-12,07 -107,61	-15,53 -80,09
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI	0,00 0,00	-83,89 -4.782,04	0,00 0,00	-83,89 -4.782,04	-95,23 -2.068,85	-98,32 -876,86	
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI	0,00 0,00	-83,89 -4.782,04	0,00 0,00	-83,89 -4.782,04	-95,23 -2.068,85	-98,32 -876,86	
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	-83,89	0,00	-83,89	-95,23	-98,32	-99,28

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	-4.782,04	0,00	-4.782,04	-2.068,85	-876,86	-511,99
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	-0,21	-2,96	-0,91	-2,96	-4,24	1.352,25	
% do CDI	-101,22	-168,58	-123,33	-168,58	-92,22	12.059,85	
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-0,34	6,41	-0,99	6,41	1,03	-94,65	-94,16
% do CDI	-157,94	365,49	-134,29	365,49	22,33	-844,08	-485,62
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	-83,41	-96,86	-96,86	-96,86	-96,85	-96,83	-97,52
Var. IPCA + 6% p.p.	-84,16	-99,85	-97,84	-99,85	-105,14	-115,40	-128,62
ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	-0,16	19,94	20,53	19,94	32,62	-20,34	
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,91	16,95	19,55	16,95	24,33	-38,90	
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	-5,63	-25,90	-14,64	-25,90	-56,78	-98,38	-99,09
% do CDI	-2.651,05	-1.476,31	-1.992,70	-1.476,31	-1.233,55	-877,37	-511,01
BRCR11	2,00	-21,49	3,47	-21,49	-3,13	5,88	-7,34
Var. IBOVESPA p.p.	-6,76	-3,68	-26,71	-3,68	2,72	-24,76	-58,47
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	-0,16	-0,91	-0,45	-0,91	-1,08	-19,45	-18,02
Var. IFIX p.p.	-5,75	11,33	-12,97	11,33	-7,94	-51,50	-53,32
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	15,41	-11,83	18,27	-11,83	11,29	-84,97	
% do CDI	7.259,72	-674,56	2.486,63	-674,56	245,17	-757,79	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	0,29	0,36	2,61	0,36	-13,10	-0,97	
Var. IFIX p.p.	-5,30	12,60	-9,91	12,60	-19,96	-33,02	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,79	-15,79	29,82	-15,79	-3,40	35,63	32,32
Var. IBOVESPA p.p.	-0,97	2,01	-0,36	2,01	2,46	5,00	-18,81
AZ QUEST ACOES FIC FIA	9,88	-17,76	33,78	-17,76	-3,83	27,38	65,07
Var. IBOVESPA p.p.	1,12	0,04	3,60	0,04	2,02	-3,26	13,95
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	8,63	-20,26	28,01	-20,26	7,24	45,66	93,56
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-2,45	-2,17	-2,45	13,09	15,02	42,44
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9,28	-22,25	27,83	-22,25	-4,41	36,54	
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
Renda Variável							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
48	10/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	600.000,00	222.700,29228000	2,6942039180
46	10/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.050.000,00	0,00	1.132.059,81908900	2,6942039180
49	26/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.810.000,00	1.041.651,99603900	2,6976379930
47	26/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	160.000,00	59.311,14568200	2,6976379930

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	0,08	-0,01	-0,34	235.943,79	0,04
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	54.665.413,69	9,60
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,54	0,05	-0,16	2.025.932,44	0,36
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,74	0,07	-0,21	1.831.845,17	0,32
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	0,75	0,07	-0,21	1.869.729,73	0,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,81	0,10	0,44	46.885.448,48	8,23
BRA1 FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,86	0,10	0,19	683.967,80	0,12
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,00	0,12	0,29	3.020.612,91	0,53
NTN-C 010421	Artigo 7º I, Alínea a	1,16	0,24	2,53	36.433.709,27	6,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,24	1,18	59.711.532,88	10,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,75	50.213.543,45	8,82
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,77	60.936.139,52	10,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	0,32	0,95	46.934.985,47	8,24
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	3,62	0,43	1,26	36.030.441,25	6,33
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	0,74	2,02	67.034.032,44	11,77
BRCR11	Artigo 8º IV, Alínea b	6,85	0,80	2,00	299.962,86	0,05
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	12,24	1,40	2,79	15.683.134,19	2,75
FI RENDA FIXA MONTE CARLO INSTIT IMA B	Artigo 7º IV, Alínea a	18,46	1,93	0,38	1.292.633,08	0,23
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,59	3,00	9,88	17.991.622,25	3,16
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	25,02	2,95	7,79	14.915.827,57	2,62
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	27,24	3,24	9,28	23.117.430,35	4,06
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,29	3,22	8,63	19.262.739,56	3,38
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	49,66	5,83	15,41	2.980.000,00	0,52
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	65,51	6,83	0,89	3.711.417,57	0,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de junho 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 4,52% 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 9,63% 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;