



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
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 21.07.2020.

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

72,48%

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	61.158,18	0,01	7.792.694.548,07	0,00
BRAM	BRANDES	BRANDES INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,40	2,02	-1,84	13.703.357,72	2,05	753.868.354,78	1,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	106.449.379,61	15,96	5.979.262.081,07	1,78
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,25	2,44	15.262,27	0,00	218.948.791,38	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,26	2,48	78.335,75	0,01	11.257.382.974,77	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,10	3,04	111.144.728,74	16,67	8.746.335.681,60	1,27
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,44	2,00	-2,03	19.569.405,54	2,93	1.214.596.338,04	1,61
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	0,77	4,73	36.675.018,67	5,50	17.164.831.993,69	0,21
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	8,96	1,41	4,81	2.451.993,98	0,37	608.337.847,65	0,40
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	1,08	3,08	13.016.134,56	1,95	4.025.627.854,04	0,32
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,42	1,14	3,02	16.052.565,35	2,41	528.945.008,55	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	1,75	55.442.900,83	8,31	10.783.491.196,95	0,51
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	66.155.316,26	9,92	12.211.119.756,17	0,54
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,09	1,09	2,51	4.447.424,89	0,67	893.476.505,39	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,26	1,29	2,04	445.262.982,35	66,77		

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	0,32	0,04	0,90	7.182.748,54	1,08	1.849.278.570,83	0,39
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	13,74	2,07	-1,97	5.698.153,38	0,85	303.285.843,11	1,88
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,40	2,03	-1,94	1.535.142,28	0,23	1.463.118.783,06	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,44	2,27	23.638.031,07	3,54	5.170.951.886,47	0,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,01	0,65	1,12	38.054.075,27	5,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

6,93

1,24

1,95

483.317.057,62

72,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,66%

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	68,93	8,75	-17,89	30.038.346,55	4,50	4.961.503.570,97	0,61
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			68,93	8,75	-17,81	30.038.346,55	4,50		

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	42,37	9,31	-22,82	3.869.542,35	0,58	557.222.173,05	0,69
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,57	7,89	-20,06	738.532,98	0,11	1.556.319.793,19	0,05
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	46,76	13,15	-22,01	15.875.474,58	2,38	628.288.800,67	2,53
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	39,99	7,79	-15,79	24.371.485,16	3,65	267.384.087,20	9,11
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	40,99	9,33	34,99	8.909.621,06	1,34	529.679.544,23	1,68
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	47,65	9,07	-17,71	16.673.669,43	2,50	655.546.824,70	2,54
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,57	7,44	-18,07	1.831.778,49	0,27	852.822.941,33	0,21
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	9.705.563,57	1,46	799.344.501,83	1,21
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,07	9,88	42,27	9.389.991,18	1,41	767.311.524,38	1,22
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	43,80	7,88	14,42	7.551.424,13	1,13	260.494.094,41	2,90
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	48,19	12,71	12,26	1.473.948,92	0,22	875.594.517,67	0,17
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	36,99	9,03	-13,70	12.876.515,50	1,93	193.454.800,51	6,66
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,27	8,96	-18,57	113.267.547,35	16,99		

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	32,56	0,85	-6,40	10.979.673,11	1,65	896.638.682,93	1,22
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,74	0,74	4,44	3.466.810,30	0,52	253.010.092,23	1,37
Sub-total Artigo 8º III			24,92	0,82	-4,01	14.446.483,41	2,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	38,24	8,12	-14,18	157.752.377,31	23,66
---	-------	------	--------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,87%

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	25,90	5,79	48,44	3.026.494,29	0,45	13.164.598,04	22,99
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	29,35	7,69	51,88	17.140.318,55	2,57	306.230.783,51	5,60
Sub-total Artigo 9º A, II			26,96	7,40	51,60	20.166.812,84	3,02		

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	29,92	0,92	23,59	5.618.347,49	0,84	1.140.664.560,63	0,49
Sub-total Artigo 9º A, III			29,92	0,92	23,59	5.618.347,49	0,84		
Investimentos no Exterior			25,22	5,92	38,75	25.785.160,33	3,87		
Total						666.854.595,26	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	445.262.982,35	66,77	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	38.054.075,27	5,71	2,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	483.317.057,62	72,48				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	30.038.346,55	4,50	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	113.267.547,35	16,99	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	14.446.483,41	2,17	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	157.752.377,31	23,66				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	20.166.812,84	3,02	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.618.347,49	0,84	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.785.160,33	3,87				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

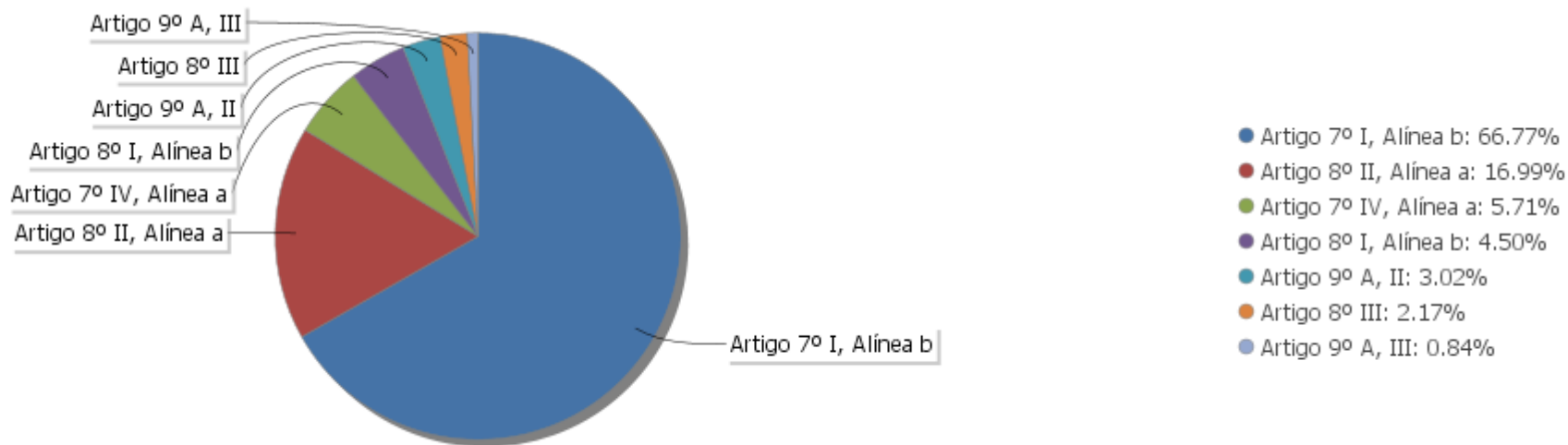
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,29 607,69	2,04 116,35	3,88 528,12	2,04 116,35	7,47 162,21	5.672.011,35	6.278.535,97
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,65 305,30	1,12 64,08	1,65 223,97	1,12 64,08	4,91 106,61	254.711,33	450.400,59
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	8,75 -0,01	-17,81 -0,01	30,16 -0,02	-17,81 -0,01		2.416.532,11	5.977.929,36
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,96 0,21	-18,57 -0,77	29,75 -0,43	-18,57 -0,77	-1,92 3,94	9.316.956,47	3.084.457,47
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,82 -7,94	-4,01 13,79	14,63 -15,55	-4,01 13,79	5,16 11,02	117.637,17	-603.824,25
Artigo 9º A, II % do CDI	7,40 3.484,19	51,60 2.941,35	33,30 4.531,05	51,60 2.941,35		1.389.153,86	6.013.531,61
Artigo 9º A, III % do CDI	0,92 432,58	23,59 1.344,45	21,91 2.982,16	23,59 1.344,45		51.134,03	819.411,40
						19.218.136,32	22.020.442,15

Análise de Liquidez

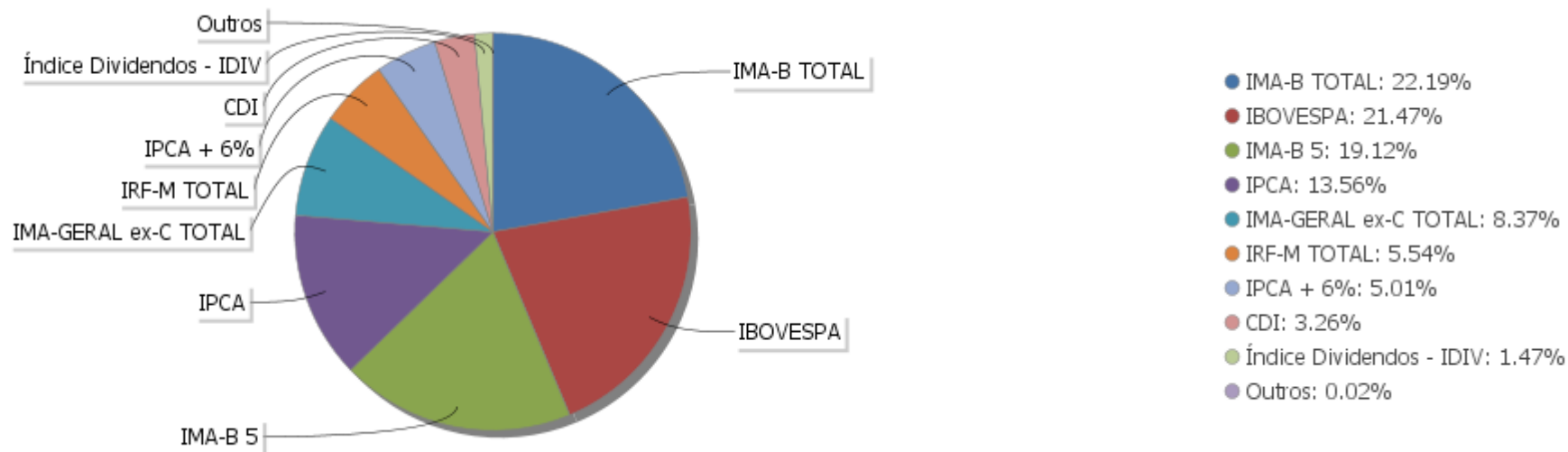
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	590.818.608,24	88,60	590.818.608,24	88,60
de 31 a 364 dias	55.535.996,78	8,33	646.354.605,02	96,93
acima de 365 dias	20.499.990,24	3,07	666.854.595,26	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

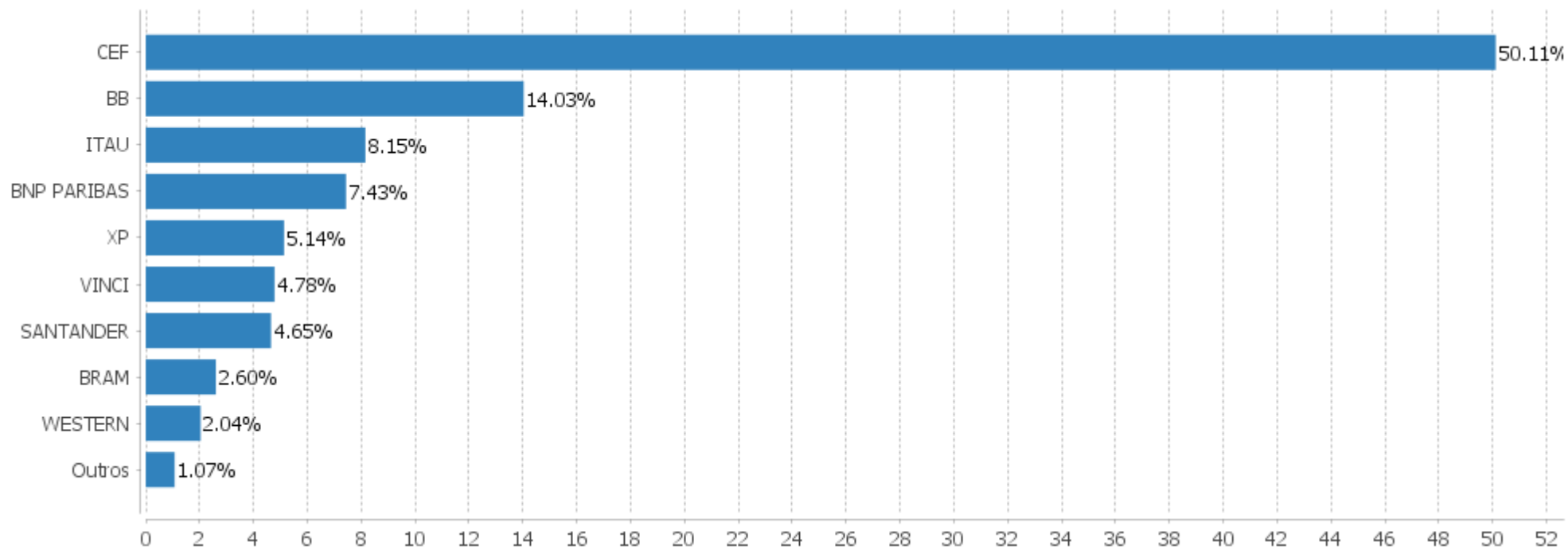


Alocação Por Estratégia



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	2,96							3,32
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,92
p.p. indexador	-0,07	-1,19	-6,27	3,14	2,87	2,22							0,40
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

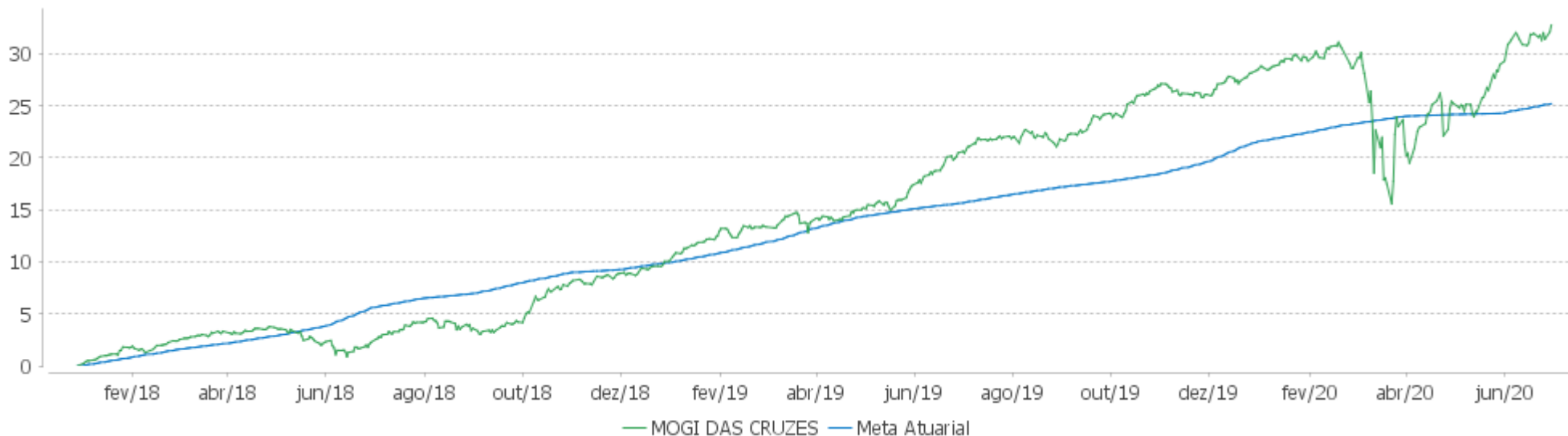
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

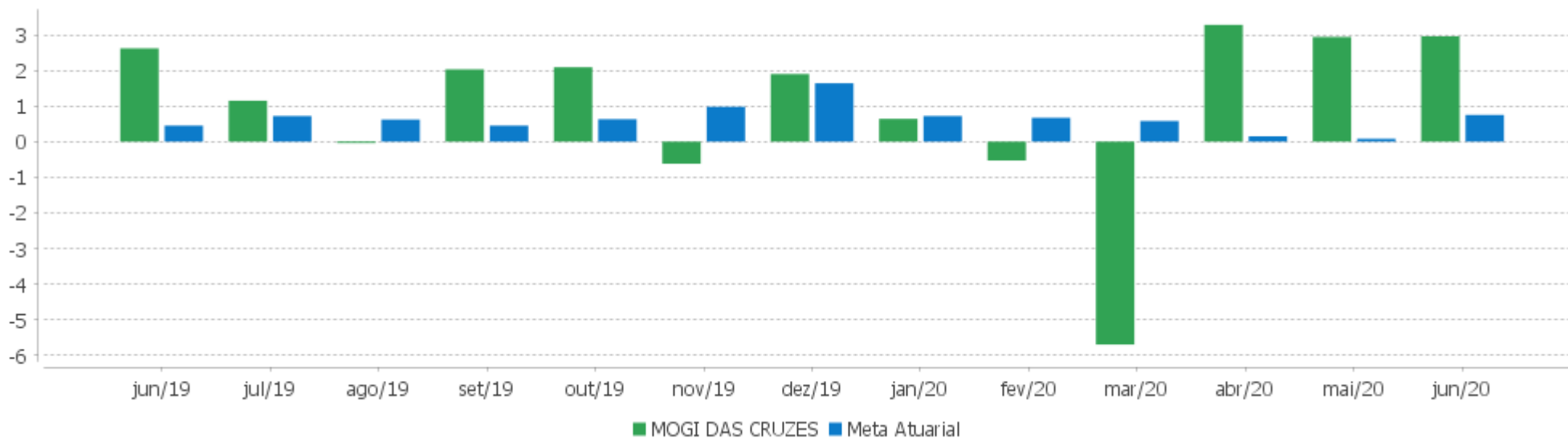
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	17	56,67	03 meses	9,46	0,95	8,51	9,61
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	43,33	06 meses	3,32	2,92	0,40	14,98
			12 meses	10,20	8,22	1,98	10,65
			24 meses	29,79	18,49	11,30	7,94
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,70	2020-03	Desde 29/12/2017	32,74	25,11	7,63	7,22

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 IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	-1,94 -0,28	4,87 -0,09	-1,94 -0,28	4,50 -0,44	34,26 -0,87	45,03 -1,18
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 0,03	-1,97 -0,31	5,16 0,20	-1,97 -0,31	4,62 -0,32	35,90 0,77	45,76 -0,45
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,04 18,39	0,90 51,49	0,32 43,32	0,90 51,49	3,57 77,60	10,11 90,16	18,21 93,93
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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,41 0,30	4,81 1,64	5,29 1,52	4,81 1,64	11,07 2,26	32,87 8,11	45,48 8,58
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,10 -0,02	3,04 -0,13	3,71 -0,06	3,04 -0,13	8,51 -0,30	24,21 -0,55	35,98 -0,92
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
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,08 -0,04	3,08 -0,09	3,71 -0,06	3,08 -0,09	8,59 -0,22	24,25 -0,51	36,09 -0,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,09 0,30	2,51 -0,74	3,28 2,05	2,51 -0,74	7,73 -0,79	29,33 10,58	42,34 12,11
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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,02	-1,84 -0,18	4,86 -0,10	-1,84 -0,18	4,59 -0,36	34,19 -0,94	44,70 -1,50
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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,14 0,40	3,02 0,03	3,50 2,51	3,02 0,03	8,41 0,12	30,53 11,97	43,28 12,17
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
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,25 -0,04	2,44 -0,16	1,05 -0,09	2,44 -0,16	5,71 -0,30	13,26 -0,41	21,82 -0,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,26	2,48	1,09	2,48	5,78	13,28	21,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,11	-0,06	-0,11	-0,23	-0,39	-0,66
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	2,00	-2,03	4,83	-2,03	4,40	34,09	44,71
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,37	-0,13	-0,37	-0,54	-1,04	-1,49
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
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	7,88	-20,03	21,07	-20,03			
Var. IBOVESPA p.p.	-0,88	-2,23	-9,11	-2,23			
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	9,33	-15,92	28,43	-15,92	5,63	56,90	79,52
Var. IBOVESPA p.p.	0,57	1,88	-1,75	1,88	11,48	26,26	28,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	4,58	-16,79	20,57	-16,79	-2,34	45,78	50,01
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,37	1,59	1,87	1,59	-2,18	-1,73	-10,56
INDIE FIC FIA	12,71	-11,85	40,44	-11,85	16,31		
Var. IBOVESPA p.p.	3,95	5,95	10,26	5,95	22,16		
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	9,31	-22,82	28,63	-22,82	-9,96	25,58	46,94
Var. IBOVESPA p.p.	0,55	-5,01	-1,55	-5,01	-4,11	-5,06	-4,19
XP INVESTOR 30 FIC FIA	9,07	-17,71	36,37	-17,71	3,52	41,31	74,19
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	0,09	6,19	0,09	9,37	10,67	23,07
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	13,15	-22,01	37,27	-22,01	3,74	40,44	46,96
Var. IBOVESPA p.p.	4,39	-4,20	7,09	-4,20	9,59	9,80	-4,16
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	7,89	-20,06	21,11	-20,06	-6,28	44,97	54,60
Var. IBOVESPA p.p.	-0,86	-2,25	-9,07	-2,25	-0,43	14,33	3,47
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	9,03	-13,70	24,65	-13,70	2,82	52,41	
Var. IBOVESPA p.p.	0,28	4,10	-5,53	4,10	8,68	21,77	
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9,88	-14,67	33,22	-14,67	5,17		
Var. IBOVESPA p.p.	1,12	3,14	3,04	3,14	11,02		
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7,44	-18,07	25,16	-18,07	-4,94	52,01	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,32	-0,26	-5,01	-0,26	0,92	21,37	
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	8,75	-17,89	30,16	-17,89	-8,57	30,92	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	-0,08	-0,02	-0,08	-2,72	0,28	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,85	-6,40	18,78	-6,40	4,13	17,08	38,07
% do CDI	398,88	-364,95	2.555,01	-364,95	89,64	152,32	196,32
BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	0,74	4,44	3,22	4,44	8,07	16,58	25,97
% do CDI	347,98	252,86	438,84	252,86	175,32	147,87	133,91
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5,79	48,44	29,91	48,44	67,98		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,96	66,25	-0,27	66,25	73,84		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	7,69	51,88	33,90	51,88			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6% p.p.	6,94	48,89	32,92	48,89			
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	0,92	23,59	21,91	23,59	40,42	67,23	
Var. IBOVESPA p.p.	-7,84	41,39	-8,26	41,39	46,28	36,60	
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

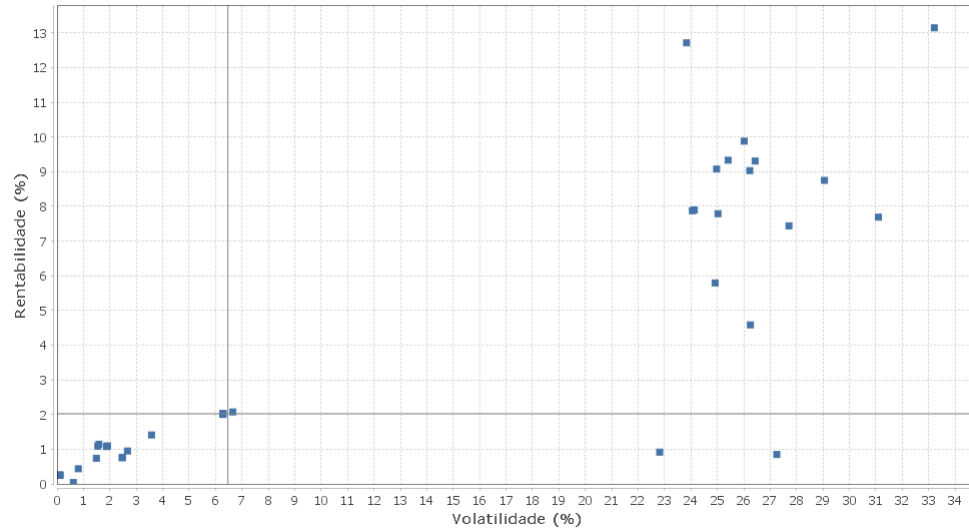
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
96	03/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	18.000,00	97,45109400	184,7080348000
101	03/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.520.519,59	13.645,96618900	184,7080348000
102	03/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	361.480,41	1.957,03673900	184,7080348000
104	03/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	809.000,00	0,00	4.379,88526600	184,7080348000
100	08/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	2.156.000,00	0,00	11.669,81966600	184,7500700000
105	09/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	809.000,00	4.378,57488900	184,7633124000
97	12/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.000,00	21,64355500	184,8125245000
98	18/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	23.000,00	124,38693100	184,9068856000
103	18/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.960.000,00	10.599,92976300	184,9068856000
99	29/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.000,00	21,65896400	184,6810442000

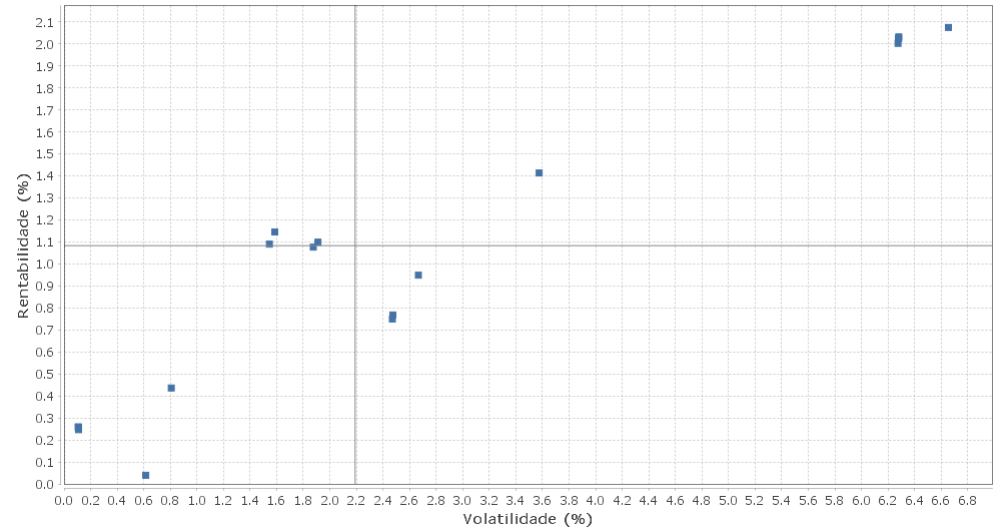
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

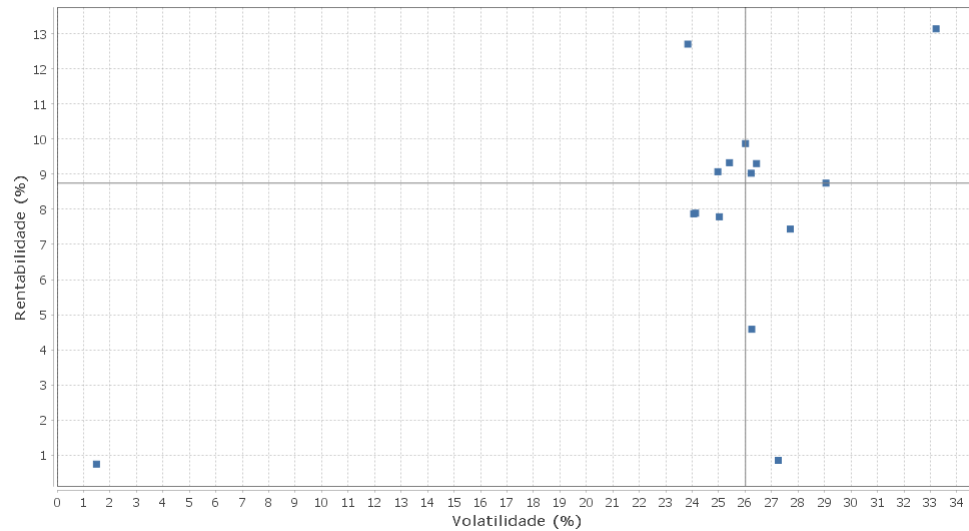
MOGI DAS CRUZES - No Mês



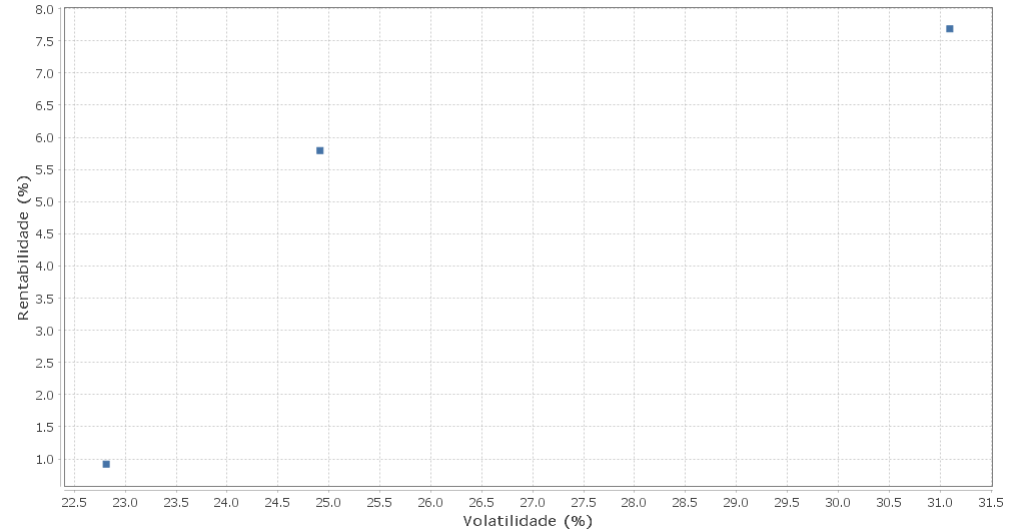
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	78.335,75	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	61.158,18	0,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,25	15.262,27	0,00
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,62	0,07	0,04	7.182.748,54	1,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,81	0,10	0,44	23.638.031,07	3,54
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	1,49	0,19	0,74	3.466.810,30	0,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,21	1,09	4.447.424,89	0,67
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,59	0,22	1,14	16.052.565,35	2,41
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,88	0,25	1,08	13.016.134,56	1,95
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,25	1,10	111.144.728,74	16,67
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,75	66.155.316,26	9,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,77	36.675.018,67	5,50
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	0,32	0,95	55.442.900,83	8,31
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,57	0,44	1,41	2.451.993,98	0,37
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,74	2,00	19.569.405,54	2,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,75	2,02	13.703.357,72	2,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,75	2,03	106.449.379,61	15,96
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,28	0,75	2,03	1.535.142,28	0,23
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,65	0,79	2,07	5.698.153,38	0,85
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	22,81	2,41	0,92	5.618.347,49	0,84
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,83	3,04	12,71	1.473.948,92	0,22
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,05	2,85	7,88	7.551.424,13	1,13
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,13	2,86	7,89	738.532,98	0,11
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,91	2,85	5,79	3.026.494,29	0,45
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,97	3,00	9,07	16.673.669,43	2,50
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	25,02	2,95	7,79	24.371.485,16	3,65
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,41	3,06	9,33	8.909.621,06	1,34
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	26,01	3,14	9,88	9.389.991,18	1,41
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,22	3,13	9,03	12.876.515,50	1,93
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	2,93	4,58	9.705.563,57	1,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	26,43	3,16	9,31	3.869.542,35	0,58
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	27,25	2,86	0,85	10.979.673,11	1,65
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,71	3,21	7,44	1.831.778,49	0,27
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	29,05	3,41	8,75	30.038.346,55	4,50
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	31,10	3,57	7,69	17.140.318,55	2,57
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	33,21	4,03	13,15	15.875.474,58	2,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

- Referente ao mês de junho de 2020, vale observar que o Instituto está com 22,99% 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;
- Saliencamos 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 16,99% dos recursos totais do Instituto, alocação esta superior ao limite máximos estipulado em Política de Investimentos.