



**LDB**  
EMPRESAS

**IPREMAR**  
OUTUBRO 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 16.11.2020.

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 90,04%

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-M	6,05	-0,31	3,99	4.648.675,71	5,42	4.799.950.020,87	0,10
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,56	0,11	2,94	828.364,58	0,97	7.887.722.403,08	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,77	0,20	-0,73	4.581.459,79	5,34	5.529.359.748,67	0,08
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,77	0,18	-0,79	760.556,02	0,89	749.634.882,25	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,83	0,19	-0,81	7.663.826,89	8,94	5.818.645.931,87	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,14	3,11	3.172.617,65	3,70	11.237.812.745,76	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	0,18	4,48	9.017.397,61	10,51	18.309.382.329,52	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,19	0,33	4,89	5.163.430,58	6,02	7.253.634.171,13	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,71	0,20	-4,62	14.371.327,35	16,76	1.936.566.655,94	0,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,97	-0,56	4,57	3.181.901,36	3,71	3.143.067.959,97	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,15	5,00	2.729.951,45	3,18	9.550.097.040,26	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,00	0,23	0,23	684.485,53	0,80	4.413.688.996,03	0,02
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>10,35</b>	<b>0,12</b>	<b>0,52</b>	<b>56.803.994,52</b>	<b>66,23</b>		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL II FI RF LP	5,85	-0,01	1,64	1.046.132,28	1,22	180.507.300,08	0,58
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,75	0,20	-0,79	6.171.605,96	7,20	2.817.438.384,20	0,22
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>11,76</b>	<b>0,17</b>	<b>-0,44</b>	<b>7.217.738,24</b>	<b>8,42</b>		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,59	-0,00	-0,00	849.999,76	0,99	640.033.097,32	0,13
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,97	0,08	2,81	641.036,28	0,75	766.439.026,51	0,08
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,77	0,18	-0,87	10.229.376,87	11,93	1.322.839.659,02	0,77
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	0,50	945.303,87	1,10	1.611.170.285,08	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,73	512.764,76	0,60	622.243.810,38	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>11,66</b>	<b>0,15</b>	<b>-0,83</b>	<b>13.178.481,54</b>	<b>15,37</b>		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICLA TRUST	MACROINVEST	SANTOS CREDIT YIELD	40,67	-0,06	65,31	21.686,45	0,03	46.252.004,09	0,05
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>40,67</b>	<b>-0,06</b>	<b>65,31</b>	<b>21.686,45</b>	<b>0,03</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>10,70</b>	<b>0,13</b>	<b>0,22</b>	<b>77.221.900,75</b>	<b>90,04</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,96%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,95	-0,82	-18,46	2.890.081,56	3,37	897.089.282,83	0,32
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>44,95</b>	<b>-0,82</b>	<b>-18,46</b>	<b>2.890.081,56</b>	<b>3,37</b>		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	39,42	0,03	-25,60	1.651.609,32	1,93	258.363.786,21	0,64
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	39,50	0,05	-17,54	4.002.889,01	4,67	793.160.820,76	0,50
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>39,10</b>	<b>0,04</b>	<b>-20,10</b>	<b>5.654.498,33</b>	<b>6,59</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>40,81</b>	<b>-0,25</b>	<b>-19,65</b>	<b>8.544.579,89</b>	<b>9,96</b>		
<b>Total</b>			<b>13,02</b>	<b>0,10</b>	<b>-2,18</b>	<b>85.766.480,64</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	56.803.994,52	66,23	0,00	59,99	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	7.217.738,24	8,42	0,00	8,00	60,00	65,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	13.178.481,54	15,37	0,00	17,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	21.686,45	0,03	0,00	0,01	5,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>77.221.900,75</b>	<b>90,04</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	2.890.081,56	3,37	0,00	7,50	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.654.498,33	6,59	0,00	7,50	20,00	25,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>8.544.579,89</b>	<b>9,96</b>				

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

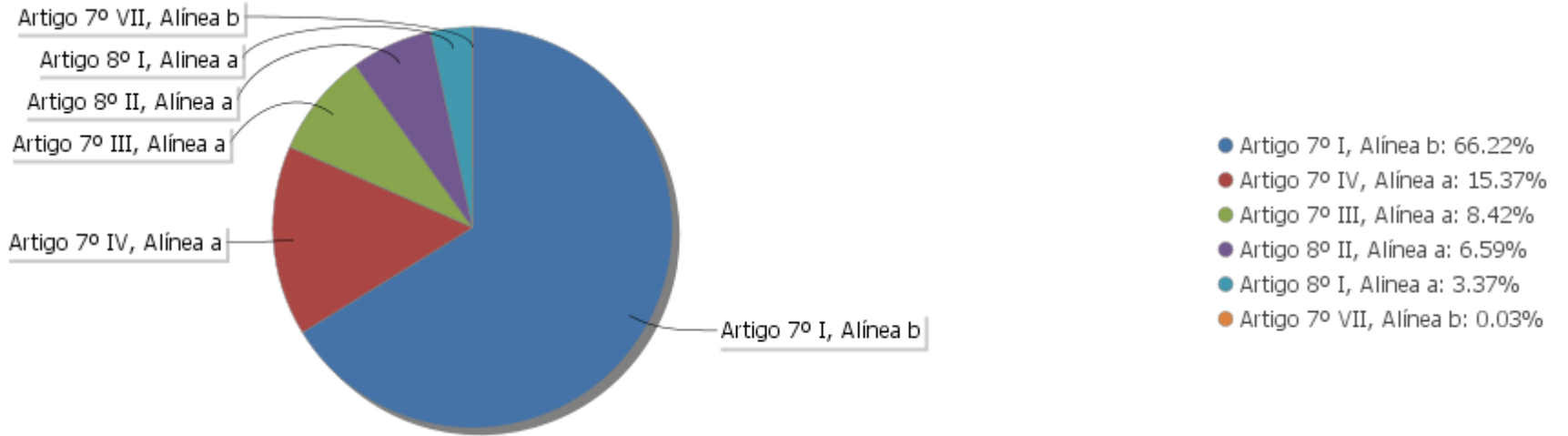
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,12 75,75	0,52 21,49	-2,40 -506,65	4,06 361,64	0,33 10,18	66.869,49	326.365,07
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,17 105,70	-0,44 -18,24	-2,92 -615,92	4,29 382,92	-1,03 -31,93	11.955,81	-32.367,85
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,15 95,75	-0,83 -33,92	-2,67 -563,51	4,16 371,24	-1,22 -37,91	19.538,24	-59.387,41
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,06 -40,28	65,31 2.681,27	-0,74 -156,55	68,20 6.080,96	65,35 2.035,30	-13,72	8.568,19
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,82 -0,13	-18,46 0,30	-8,89 -0,19	16,42 -0,29	-11,42 0,95	-23.790,60	-667.974,34
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,04 0,73	-20,10 -1,34	-8,89 -0,18	7,69 -9,01	-11,35 1,02	2.495,37	-1.255.579,53
						77.054,59	-1.680.375,87

**Análise de Liquidez**

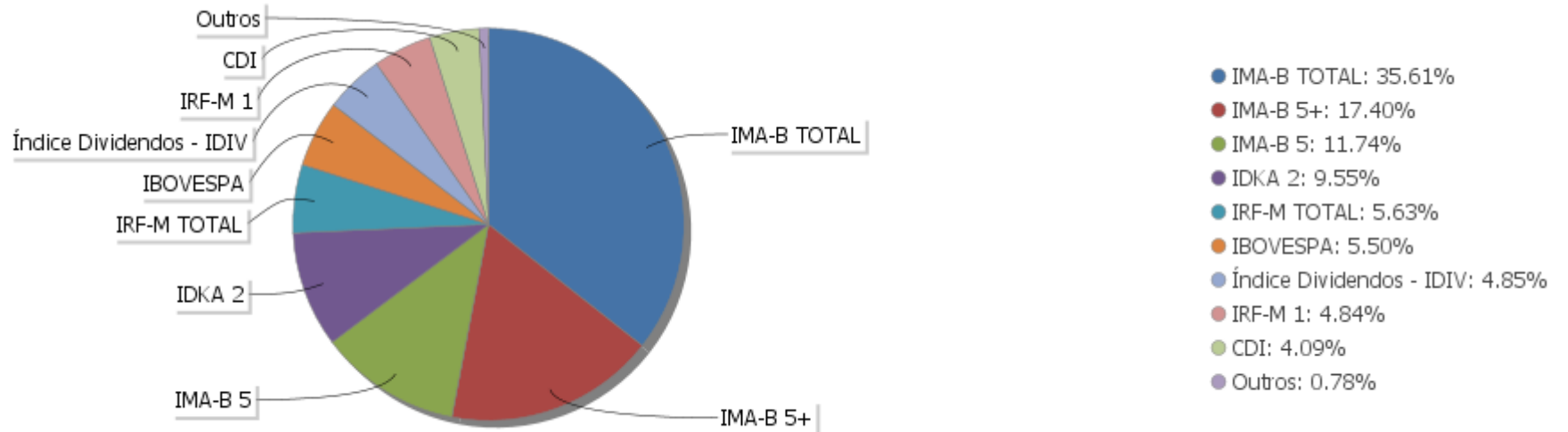
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	81.763.591,63	95,33	81.763.591,63	95,33
de 31 a 364 dias	4.002.889,01	4,67	85.766.480,64	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	85.766.480,64	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



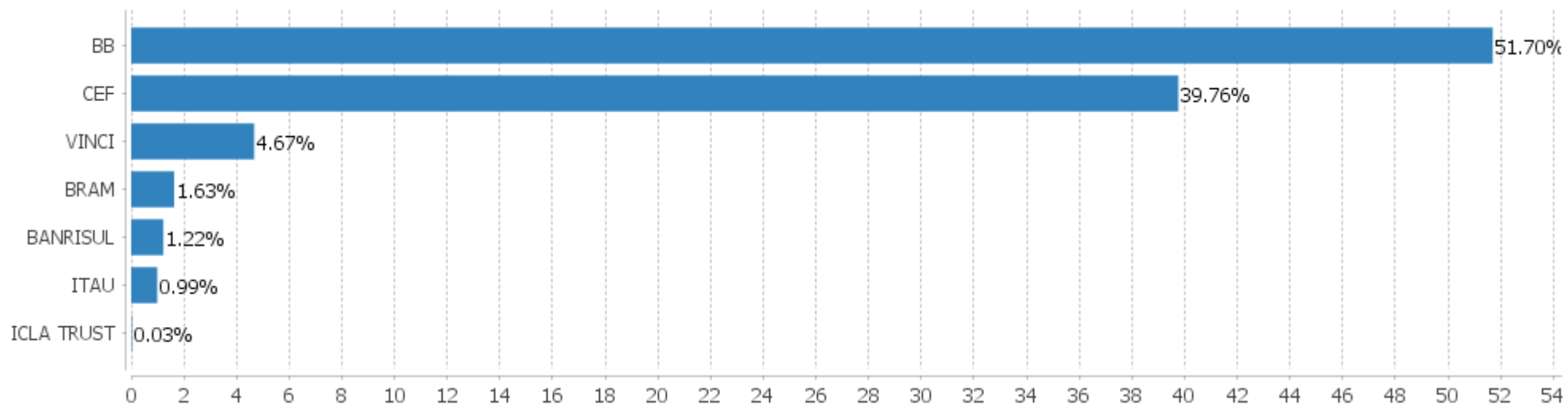
Alocação Por Estratégia





## 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	0,34	-0,51	-8,23	1,90	1,99	2,11	3,91	-1,72	-1,58	0,10			-2,18
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38			8,05
p.p. indexador	-0,36	-1,10	-8,92	1,66	1,78	1,33	2,94	-2,56	-2,94	-1,28			-10,23
2019	3,51	0,40	0,47	1,27	2,74	3,16	1,19	-0,11	2,37	2,86	-1,69	2,40	20,09
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,64	-0,61	-0,74	0,18	2,08	2,71	0,56	-0,74	1,93	2,29	-2,69	0,68	9,31
2018	2,43	0,58	0,89	0,09	-2,37	-0,26	1,91	-0,36	0,27	5,21	0,92	1,41	11,04
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,68	-0,02	0,33	-0,60	-3,28	-2,19	1,15	-0,89	-0,47	4,29	0,70	0,80	1,45

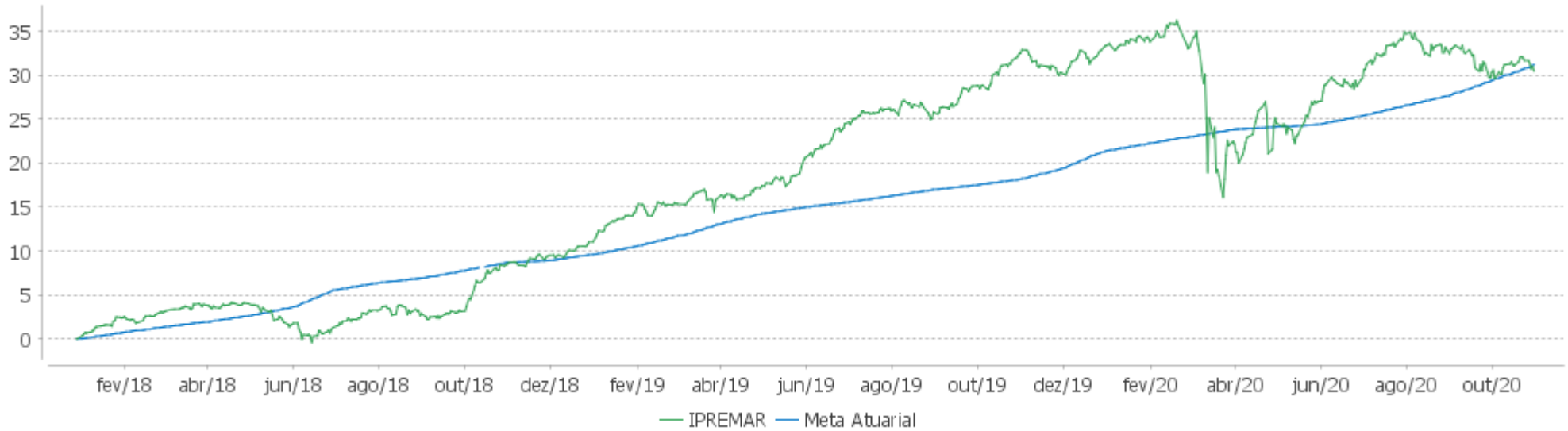
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

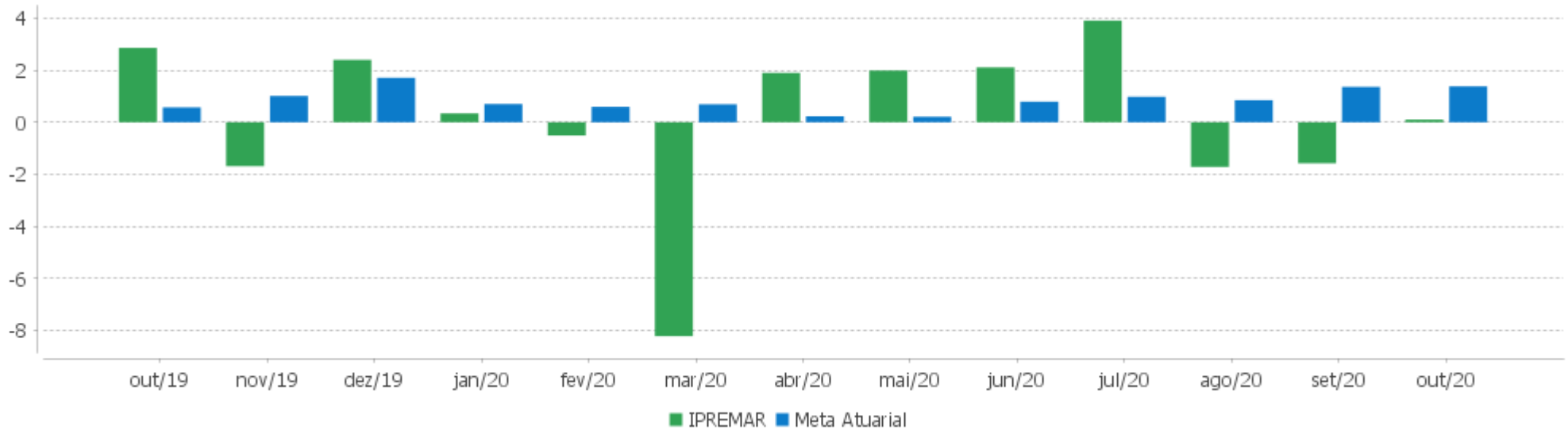
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	52,94	03 meses	-3,18	3,63	-6,81	6,49
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	47,06	06 meses	4,79	5,69	-0,91	6,65
			12 meses	-1,53	11,01	-12,53	13,02
			24 meses	20,22	20,67	-0,46	9,63
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,21	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-8,23	2020-03	Desde 29/12/2017	30,44	31,17	-0,73	8,40

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
SANTOS CREDIT YIELD % do CDI	-0,06 -40,26	65,31 2.680,91	-0,74 -156,55	68,20 6.080,96	65,34 2.035,03	152,40 1.585,03	280,31 1.669,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,56 0,05	4,57 -0,19	-2,69 -0,06	1,65 -0,09	4,41 -0,22	22,74 -0,67	35,49 -0,71
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,02	-0,81 -0,30	-3,15 -0,07	4,68 -0,13	-1,41 -0,40	24,69 -0,78	37,24 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,02	4,48 -0,24	0,41 -0,09	4,66 -0,15	5,38 -0,33	19,69 -0,58	30,54 -0,92
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,33 0,29	4,89 -0,56	1,13 0,04	5,25 0,40	6,32 -0,41	18,19 -1,41	28,86 -2,40
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,11 -0,05	2,94 -0,34	0,24 -0,19	1,13 -0,25	3,67 -0,39	10,79 -0,70	18,38 -0,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,15 0,12	5,00 -0,45	0,98 -0,11	4,98 0,13	6,16 -0,57	18,25 -1,35	29,01 -2,25
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,19 -0,01	4,50 -0,22	0,40 -0,10	4,62 -0,19	5,42 -0,29	19,71 -0,56	30,59 -0,88
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,14 -0,02	3,11 -0,17	0,37 -0,06	1,27 -0,10	3,85 -0,21	11,05 -0,44	18,71 -0,65
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,31 0,01	3,99 -0,28	-1,76 -0,13	1,49 -0,15	4,12 -0,31	19,16 -0,62	30,15 -0,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-0,73 -0,23	-3,19 -0,11	4,62 -0,19	-1,29 -0,28	24,83 -0,64	37,31 -1,07
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18 -0,03	-0,79 -0,28	-3,15 -0,07	4,65 -0,16	-1,33 -0,33	24,62 -0,85	36,97 -1,41
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,20 -0,02	-4,62 -0,28	-6,05 -0,12	4,65 -0,25	-6,05 -0,20	28,32 -0,66	41,82 -1,20
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-0,00 -0,32	0,38 15,71	-3,55 -748,56	4,37 389,24	-0,41 -12,91	28,07 291,97	40,76 242,73
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18 -0,03	-0,87 -0,37	-3,16 -0,08	4,73 -0,08	-1,40 -0,39	24,57 -0,90	37,18 -1,21
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 35,66	1,48 60,70	0,13 27,58	0,52 46,41	2,07 64,40	7,24 75,26	13,03 77,62
BRANCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,08	2,81	-1,05	3,03	2,93	18,31	28,80

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,01	0,31	0,06	0,40	0,26	0,44	0,44
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 55,36	1,73 70,85	0,26 55,74	0,70 62,32	2,36 73,40	7,80 81,13	13,92 82,88
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL II FI RF LP % do CDI	-0,01 -5,00	1,64 67,45	-1,43 -301,64	2,16 192,61	1,78 55,55	16,03 166,67	25,90 154,24
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-0,79 -0,28	-3,17 -0,09	4,66 -0,15	-1,37 -0,37	24,61 -0,86	37,33 -1,06
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,05 -0,60	-17,54 3,02	-8,51 0,13	11,41 0,08	-10,04 0,54	27,58 3,08	32,28 1,32
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	0,03 0,71	-25,60 -6,84	-9,77 -1,07	-0,37 -17,07	-13,48 -1,11	13,00 5,53	22,44 -3,99
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,82 -0,13	-18,46 0,30	-8,89 -0,19	16,42 -0,29	-11,42 0,95	11,13 3,66	26,93 0,49
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

**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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
<b>Meta Atuarial</b>							

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

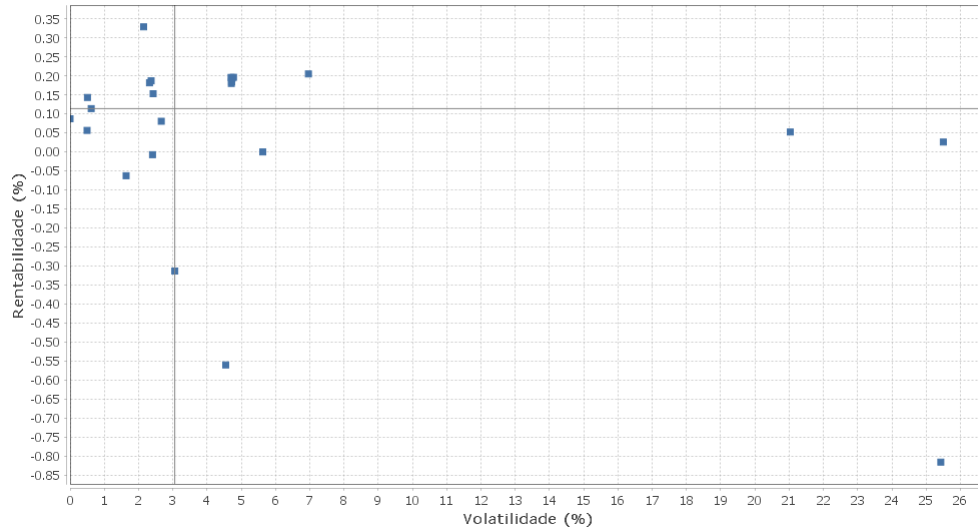
## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
45	05/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.000,00	739,29326200	2,7052863910
49	15/10/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	519.000,00	0,00	25.989,47030800	19,9696259230
53	15/10/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	500.000,00	0,00	160.062,79583600	3,1237740000
44	16/10/2020	BB PREV RF IMA-B	92.000,00	0,00	16.920,33069700	5,4372459760
50	16/10/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	164.000,00	0,00	8.207,08641200	19,9827309910
46	20/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.500,00	1.291,51609900	2,7099933190
51	20/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.500,00	8.671,60809400	2,7099933190
47	23/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.300,00	1.956,11052500	2,7094583520
52	28/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	384.000,00	141.676,97392800	2,7103910350
48	29/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	32.000,00	11.801,97148800	2,7114113970

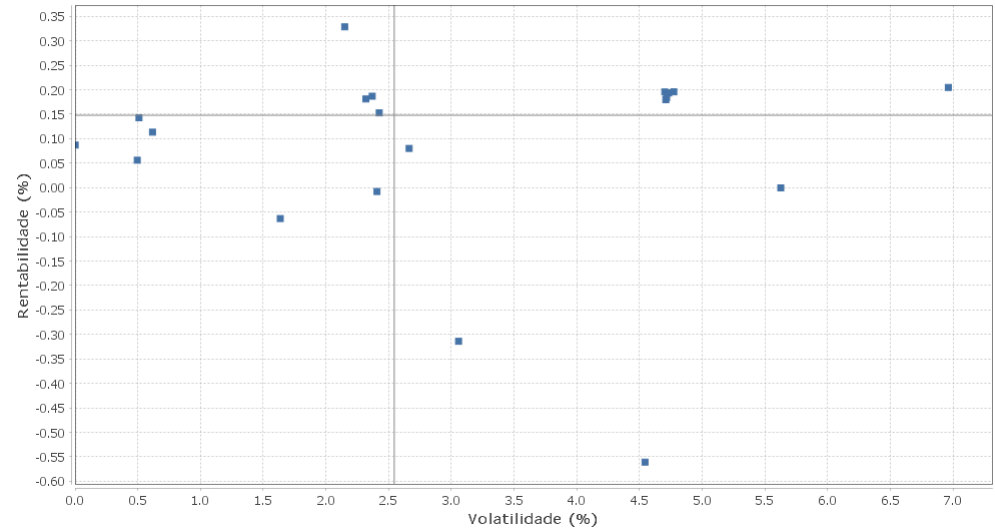
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

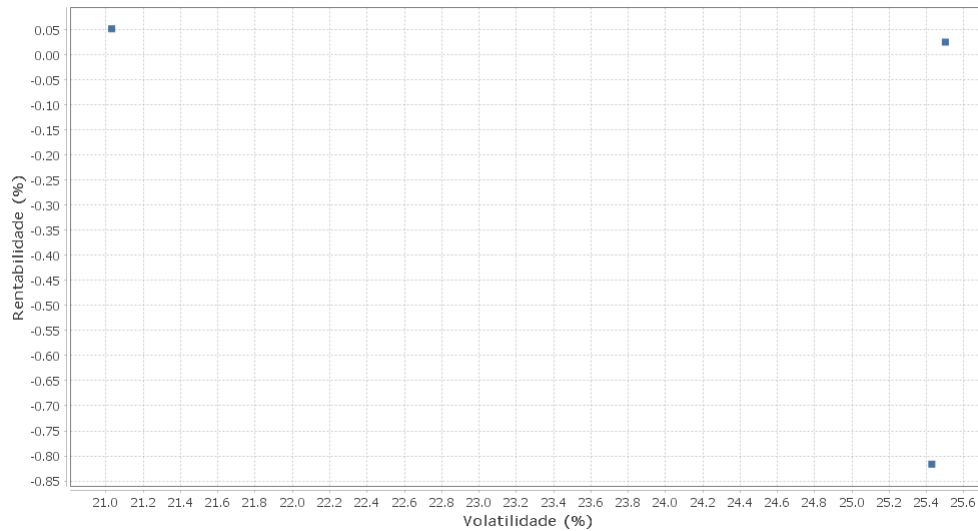
IPREMAR - No Mês



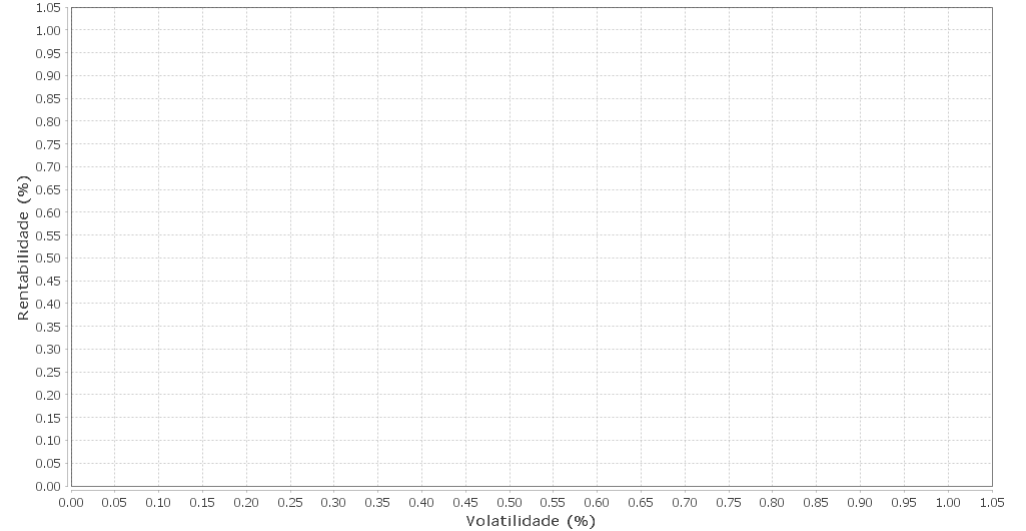
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-71,82	0,09	512.764,76	0,60
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,50	0,06	0,00	-0,20	0,06	945.303,87	1,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,51	0,16	0,00	-0,03	0,14	3.172.617,65	3,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,17	0,00	-0,07	0,11	828.364,58	0,97
SANTOS CREDIT YIELD	Artigo 7º VII, Alínea b	1,64	2,16	0,00	-0,13	-0,06	21.686,45	0,03
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	0,90	0,04	0,08	0,33	5.163.430,58	6,02
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,02	0,08	0,01	0,18	9.017.397,61	10,51
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,37	1,09	0,01	0,01	0,19	684.485,53	0,80
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL II FI RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	2,41	1,19	0,01	-0,07	-0,01	1.046.132,28	1,22
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,08	0,02	-0,00	0,15	2.729.951,45	3,18
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,66	1,19	0,01	-0,03	0,08	641.036,28	0,75
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,06	1,36	0,06	-0,15	-0,31	4.648.675,71	5,42
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,54	2,04	0,07	-0,16	-0,56	3.181.901,36	3,71
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,70	3,15	0,22	0,01	0,20	6.171.605,96	7,20
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,71	3,15	0,36	0,00	0,18	10.229.376,87	11,93
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,72	3,15	0,03	0,01	0,18	760.556,02	0,89
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,73	3,16	0,27	0,01	0,19	7.663.826,89	8,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	3,15	0,16	0,01	0,20	4.581.459,79	5,34
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,63	3,35	0,03	-0,03	-0,00	849.999,76	0,99
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,96	4,93	0,78	0,01	0,20	14.371.327,35	16,76
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,03	9,83	0,36	-0,00	0,05	4.002.889,01	4,67
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,43	10,36	0,27	-0,04	-0,82	2.890.081,56	3,37
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	25,50	11,61	0,16	-0,01	0,03	1.651.609,32	1,93