



LDB
EMPRESAS

TAIÓ
JULHO 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 18.08.2020.

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 81,50%

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 | 5,87 | 1,13 | 5,86 | 193.784,98 | 0,44 | 5.350.645.859,80 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,54 | 0,23 | 2,69 | 5.807.733,03 | 13,09 | 7.835.713.656,67 | 0,07 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 12,47 | 4,36 | 2,54 | 5.586.200,45 | 12,59 | 5.823.784.558,48 | 0,10 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,53 | 0,22 | 2,66 | 277.321,80 | 0,62 | 946.282.128,30 | 0,03 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,95 | 0,97 | 4,05 | 1.826.995,47 | 4,12 | 12.027.903.790,65 | 0,02 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 4,11 | 0,81 | 3,71 | 4.090.941,33 | 9,22 | 6.099.396.938,17 | 0,07 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO | 8,70 | 1,50 | 7,47 | 623.120,30 | 1,40 | 3.049.933.927,01 | 0,02 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 4,92 | 0,97 | 4,08 | 3.061.741,17 | 6,90 | 4.153.926.563,49 | 0,07 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 6,08 | 1,77 | 3,55 | 1.472.690,89 | 3,32 | 10.799.663.748,52 | 0,01 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 4,29 | 1,16 | 3,96 | 22.940.529,42 | 51,69 | | |

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 |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|--------------|------------------|---------|
| CEF | CEF | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 12,47 | 4,40 | 2,46 | 7.584.854,11 | 17,09 | 2.998.036.270,63 | 0,25 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 12,47 | 4,40 | 2,46 | 7.584.854,11 | 17,09 | | |

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 |
|---|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 13,04 | 4,47 | 2,70 | 5.409.872,78 | 12,19 | 1.967.216.400,50 | 0,28 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,07 | 0,10 | 1,35 | 238.094,58 | 0,54 | 1.725.378.039,09 | 0,01 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 12,14 | 4,15 | 2,21 | 5.647.967,36 | 12,73 | | |
| Renda Fixa | | | 7,13 | 2,29 | 3,36 | 36.173.350,89 | 81,50 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,50%

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 |
|---|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|--------------|------------------|---------|
| BRAM | BEM | BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 43,20 | 8,23 | -8,64 | 1.877.437,15 | 4,23 | 2.138.402.416,21 | 0,09 |
| BB | BB | BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI | 45,89 | 9,09 | -18,59 | 1.305.282,17 | 2,94 | 261.582.878,53 | 0,50 |
| VINCI | CEF | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 39,01 | 8,32 | -9,87 | 1.508.139,72 | 3,40 | 862.156.434,48 | 0,17 |
| CEF | CEF | FI EM AÇÕES CAIXA IBRX ATIVO | 43,97 | 8,44 | 21,08 | 1.753.130,85 | 3,95 | 144.930.036,49 | 1,21 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 41,33 | 8,44 | -11,72 | 6.443.989,89 | 14,52 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| CEF | CEF | FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT | 1,76 | 0,05 | 1,85 | 1.764.477,68 | 3,98 | 507.871.987,12 | 0,35 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 1,76 | 0,05 | 1,85 | 1.764.477,68 | 3,98 | | |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--|--------------|-------------|--------------|----------------------|---------------|--|--|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 28,36 | 6,29 | -7,86 | 8.208.467,57 | 18,50 | | |
| Total | | | | | | 44.381.818,46 | 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 | 22.940.529,42 | 51,69 | 0,00 | 50,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa Referenciados | 7.584.854,11 | 17,09 | 0,00 | 15,00 | 60,00 | 60,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 5.647.967,36 | 12,73 | 0,00 | 10,00 | 40,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 36.173.350,89 | 81,50 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 6.443.989,89 | 14,52 | 0,00 | 5,00 | 20,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 1.764.477,68 | 3,98 | 0,00 | 4,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 8.208.467,57 | 18,50 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

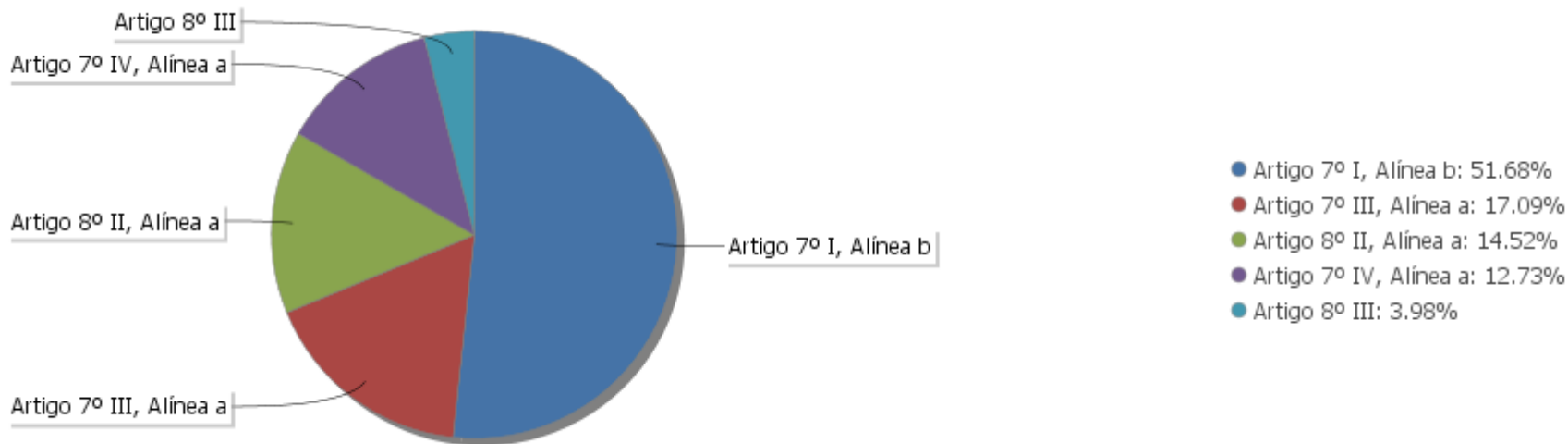
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|------------------|-----------------|------------------|-----------------|----------------|--------------|-------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,16 595,93 | 3,96 202,69 | 3,46 537,59 | 3,41 217,47 | 7,58 179,73 | 262.636,12 | 868.464,75 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 4,40 2.262,18 | 2,46 125,96 | 8,09 1.256,98 | 2,22 141,71 | 7,80 185,00 | 322.681,77 | 172.108,96 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 4,15 2.136,59 | 2,21 113,30 | 7,80 1.212,23 | 1,94 123,35 | 7,02 166,48 | 232.237,13 | 149.140,45 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 8,44 0,18 | -11,72 -0,71 | 25,12 -2,71 | -11,65 -2,11 | 1,82 0,74 | 428.361,56 | -486.186,03 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 0,05 -8,21 | 1,85 12,86 | 0,43 -27,40 | 1,53 11,06 | 4,66 3,58 | 965,42 | 31.995,60 |
| | | | | | | 1.246.882,00 | 735.523,73 |

Análise de Liquidez

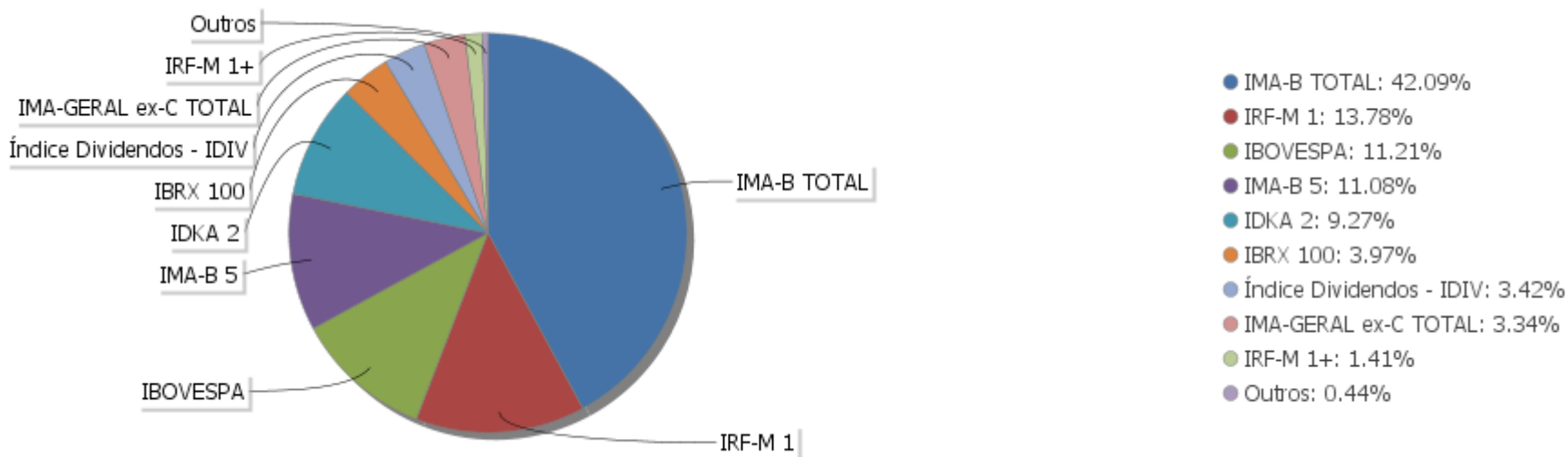
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 41.109.201,06 | 92,63 | 41.109.201,06 | 92,63 |
| de 31 a 364 dias | 3.272.617,40 | 7,37 | 44.381.818,46 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 44.381.818,46 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

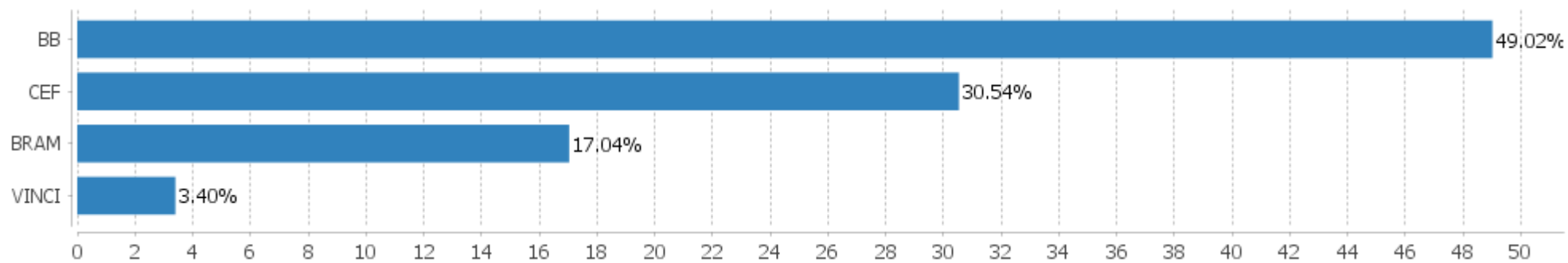


Alocação Por Estratégia



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 | 0,35 | -0,41 | -6,40 | 1,54 | 1,84 | 2,08 | 2,93 | | | | | | 1,63 |
| IPCA + 5,89% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,89 | | | | | | 3,85 |
| p.p. indexador | -0,36 | -1,07 | -6,97 | 1,39 | 1,76 | 1,34 | 2,04 | | | | | | -2,21 |
| 2019 | 1,10 | 0,44 | 0,46 | 0,71 | 1,77 | 2,14 | 1,17 | 0,10 | 1,74 | 1,90 | -0,75 | 2,09 | 13,60 |
| 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 | 0,27 | -0,46 | -0,74 | -0,35 | 1,13 | 1,69 | 0,45 | -0,52 | 1,30 | 1,26 | -1,73 | 0,45 | 3,01 |
| 2018 | | | | | | | | | | | | 0,93 | 0,93 |
| IPCA + 6% | | | | | | | | | | | | 0,61 | 0,61 |
| p.p. indexador | | | | | | | | | | | | 0,31 | 0,31 |

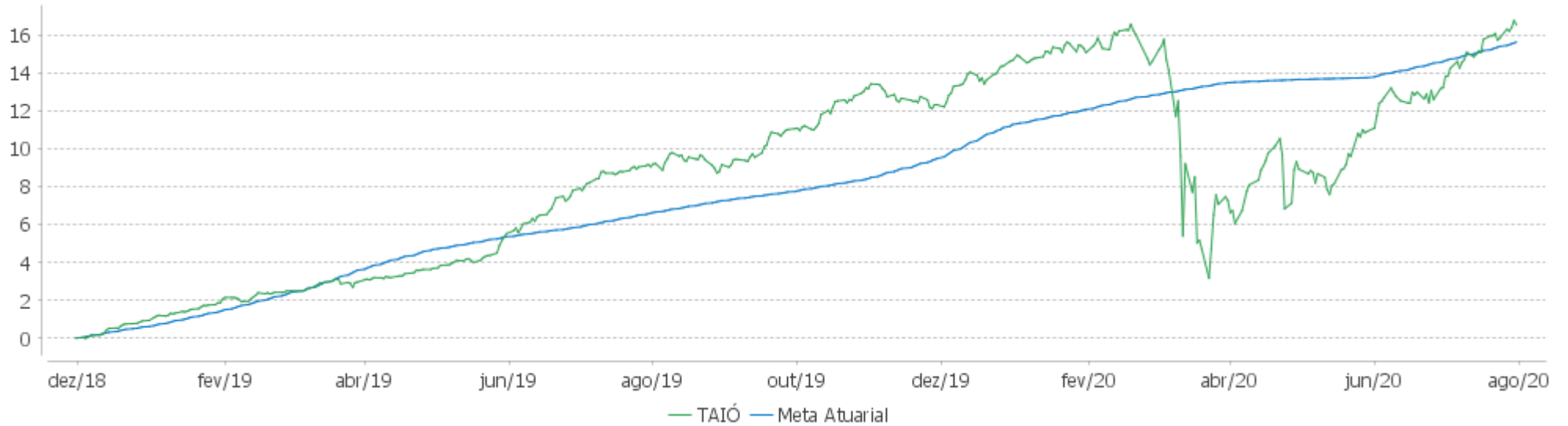
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

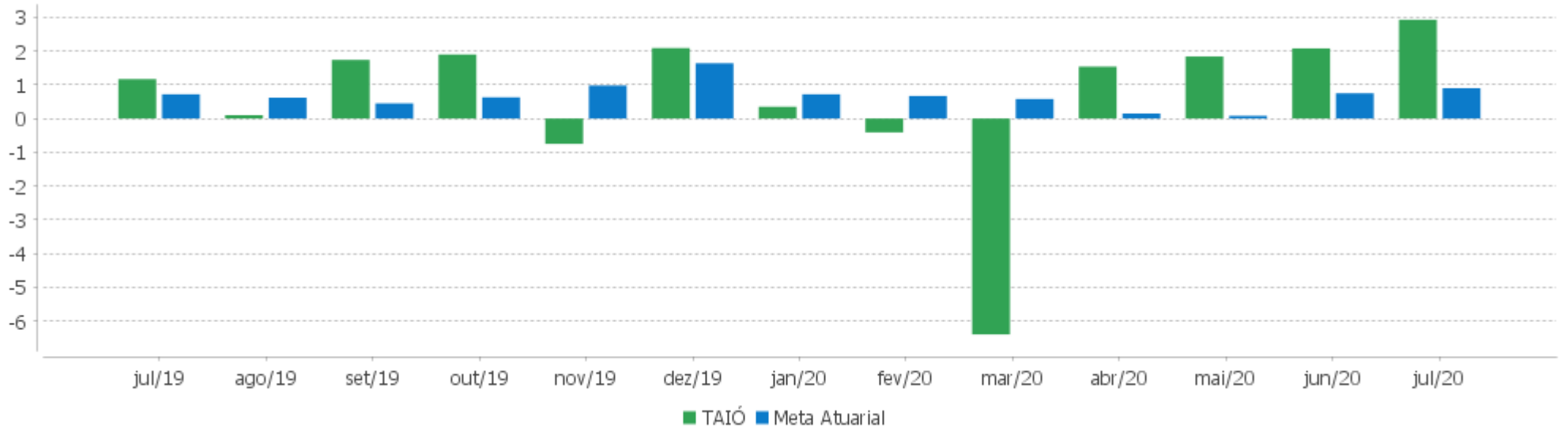
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 12 | 60,00 | 03 meses | 7,00 | 1,71 | 5,29 | 5,18 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 8 | 40,00 | 06 meses | 1,28 | 3,11 | -1,83 | 13,27 |
| | | | 12 meses | 6,87 | 8,40 | -1,53 | 9,48 |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,93 | 2020-07 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,40 | 2020-03 | Desde 30/11/2018 | 16,53 | 15,55 | 0,98 | 7,43 |

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 IRF-M 1+ TITULO Var. IRF-M 1+ p.p. | 1,50 0,03 | 7,47 -0,12 | 4,47 -0,03 | 6,32 -0,08 | 11,77 -0,24 | 32,19 -0,62 | 42,77 -1,01 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,97 -0,02 | 4,05 -0,15 | 4,23 -0,05 | 3,48 -0,13 | 8,54 -0,29 | 23,61 -0,55 | 33,54 -0,89 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 0,81 -0,13 | 3,71 -0,60 | 4,07 0,35 | 3,32 -0,44 | 7,99 -0,69 | 20,62 -1,75 | 30,76 -2,60 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 1,77 0,11 | 3,55 0,15 | 3,83 0,26 | 3,05 0,17 | 7,10 0,02 | 23,78 0,51 | 32,81 0,56 |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p. | 0,22 -0,02 | 2,66 -0,18 | 0,87 -0,07 | 2,24 -0,15 | 5,21 -0,30 | 12,59 -0,61 | 20,63 -0,93 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 0,23 -0,01 | 2,69 -0,15 | 0,88 -0,06 | 2,26 -0,13 | 5,22 -0,29 | 12,65 -0,54 | 20,70 -0,86 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,97 -0,02 | 4,08 -0,11 | 4,20 -0,08 | 3,51 -0,11 | 8,59 -0,24 | 23,64 -0,51 | 33,60 -0,83 |
| BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p. | 1,13 0,04 | 5,86 -0,14 | 3,31 -0,01 | 4,96 -0,12 | 9,57 -0,24 | 26,04 -0,55 | 35,92 -0,87 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,36 -0,02 | 2,54 -0,11 | 8,07 -0,07 | 2,27 -0,11 | 7,94 -0,22 | 37,20 -0,66 | 45,69 -1,07 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,40 0,01 | 2,46 -0,19 | 8,09 -0,05 | 2,22 -0,16 | 7,80 -0,36 | 36,97 -0,90 | 45,75 -1,00 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,47 0,09 | 2,70 0,05 | 8,39 0,25 | 2,42 0,04 | 8,21 0,05 | 37,96 0,09 | 46,44 -0,31 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 0,10 52,46 | 1,35 68,95 | 0,39 60,44 | 1,06 67,36 | 3,12 74,14 | 8,50 78,50 | 14,95 80,06 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT Var. IBOVESPA p.p. | 0,05 -8,21 | 1,85 12,86 | 0,43 -27,40 | 1,53 11,06 | 4,66 3,58 | | |
| BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p. | 9,09 0,82 | -18,59 -7,58 | 28,30 0,47 | -15,25 -5,71 | -9,83 -10,91 | 27,21 -2,69 | 45,36 -10,75 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 8,32 1,79 | -9,87 3,18 | 21,78 -0,08 | -11,23 0,43 | 4,70 1,20 | 50,50 4,00 | 62,91 -0,28 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p. | 8,23 -0,04 | -8,64 2,37 | 24,69 -3,15 | -10,09 -0,55 | 9,43 8,35 | 58,19 28,28 | 87,18 31,06 |
| FI EM AÇÕES CAIXA IBRX ATIVO | 8,44 | -11,91 | 28,80 | -11,03 | 1,20 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IBRX 100 p.p. | 0,02 | -1,48 | 0,60 | -1,74 | -0,97 | | |
| CDI | 0,19 | 1,95 | 0,64 | 1,57 | 4,21 | 10,83 | 18,68 |
| IBOVESPA | 8,27 | -11,01 | 27,83 | -9,54 | 1,08 | 29,91 | 56,12 |
| INPC + 6% | 0,98 | 4,26 | 1,99 | 3,54 | 8,88 | 19,01 | 30,64 |
| IPCA + 6% | 0,90 | 3,91 | 1,73 | 3,16 | 8,47 | 18,63 | 31,32 |

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 | 0,24 | 2,84 | 0,94 | 2,39 | 5,51 | 13,20 | 21,56 |
| IRF-M 1+ | 1,47 | 7,59 | 4,50 | 6,40 | 12,02 | 32,81 | 43,78 |
| IRF-M TOTAL | 1,08 | 6,00 | 3,32 | 5,08 | 9,81 | 26,59 | 36,79 |
| IMA-B 5 | 0,99 | 4,19 | 4,28 | 3,61 | 8,83 | 24,16 | 34,43 |
| IMA-B 5+ | 7,32 | 1,68 | 11,51 | 1,64 | 7,81 | 49,37 | 56,19 |
| IMA-B TOTAL | 4,39 | 2,65 | 8,14 | 2,38 | 8,16 | 37,86 | 46,75 |
| IMA-C TOTAL | 4,26 | 12,04 | 11,01 | 9,27 | 15,97 | 43,97 | 64,91 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 1,66 | 3,39 | 3,57 | 2,88 | 7,07 | 23,27 | 32,25 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,74 | 3,64 | 3,79 | 3,07 | 7,33 | 23,84 | 33,11 |
| IDKA 2 | 0,94 | 4,31 | 3,72 | 3,76 | 8,68 | 22,37 | 33,35 |
| IDKA 20 | 12,08 | -1,74 | 17,28 | -0,38 | 4,95 | 69,37 | 71,28 |
| CDI | 0,19 | 1,95 | 0,64 | 1,57 | 4,21 | 10,83 | 18,68 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | 8,27 | -11,01 | 27,83 | -9,54 | 1,08 | 29,91 | 56,12 |
| IBRX 100 | 8,41 | -10,43 | 28,20 | -9,30 | 2,17 | 33,69 | 59,04 |
| IBRX 50 | 8,15 | -11,06 | 29,00 | -9,35 | 0,23 | 26,69 | 52,24 |
| SMALL CAP | 9,50 | -13,20 | 31,66 | -13,59 | 7,86 | 55,28 | 71,97 |
| IFIX | -2,61 | -14,53 | 4,97 | -11,18 | 2,77 | 26,86 | 32,28 |
| Índice Consumo - ICON | 7,62 | -4,11 | 27,54 | -7,49 | 12,15 | 54,44 | 58,02 |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,53 | -13,05 | 21,87 | -11,65 | 3,50 | 46,49 | 63,19 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,36 | 0,46 | 0,24 | 0,25 | 2,31 | 5,60 | 10,34 |
| INPC | 0,44 | 0,80 | 0,49 | 0,61 | 2,69 | 5,94 | 9,76 |
| IGPM | 2,23 | 6,71 | 4,11 | 6,21 | 9,27 | 16,26 | 25,84 |
| SELIC | 0,19 | 1,95 | 0,64 | 1,57 | 4,21 | 10,83 | 18,69 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

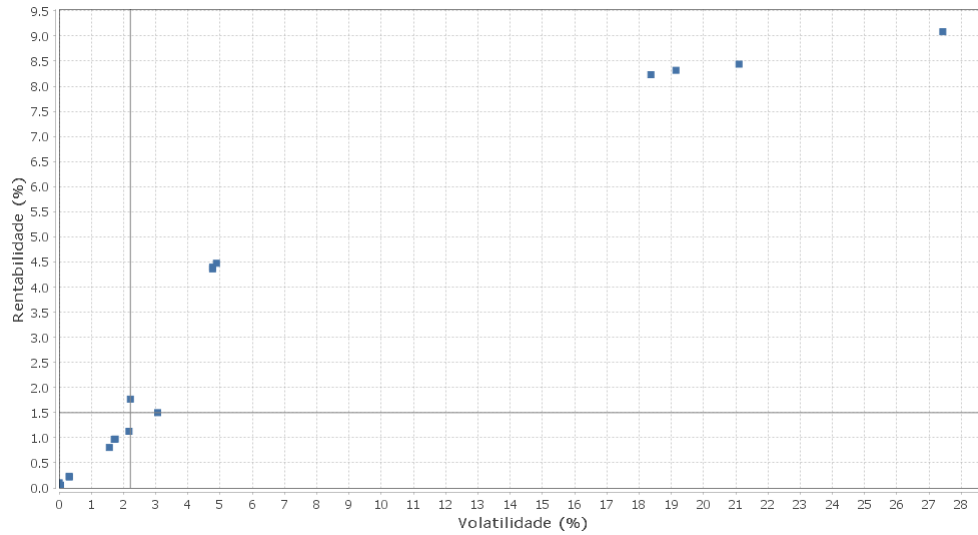
Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|---|--------------|--------------|------------------|--------------|
| 94 | 02/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 76.274,89 | 0,00 | 36.215,50631400 | 2,1061389930 |
| 95 | 03/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 210.091,83 | 0,00 | 99.747,75124900 | 2,1062312420 |
| 102 | 08/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 7.118,89 | 3.379,48968200 | 2,1064985160 |
| 98 | 15/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 5.680,04 | 2.695,84100200 | 2,1069640220 |
| 96 | 16/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 18.628,16 | 0,00 | 8.840,83149600 | 2,1070597270 |
| 103 | 20/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 64,99 | 30,84128100 | 2,1072406070 |
| 104 | 21/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 13,21 | 6,26858800 | 2,1073325440 |
| 105 | 22/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 614.400,52 | 0,00 | 291.540,46909100 | 2,1074279050 |
| 106 | 24/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 154.053,12 | 0,00 | 73.093,70253400 | 2,1076113900 |
| 107 | 28/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 798.614,36 | 378.885,44832465 | 2,1077989760 |
| 92 | 29/07/2020 | BB PREV RF IRF-M | 0,00 | 3.800.000,00 | 623.730,45984300 | 6,0923752240 |
| 93 | 29/07/2020 | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 3.800.000,00 | 0,00 | 606.286,46681800 | 6,2676642280 |
| 99 | 29/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 45.599,80 | 21.632,88519300 | 2,1078926640 |
| 101 | 29/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 17.158,80 | 0,00 | 8.140,26268600 | 2,1078926640 |
| 109 | 29/07/2020 | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 0,00 | 95.670,48 | 25.380,78962200 | 3,7694050000 |
| 100 | 30/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 220.454,55 | 104.581,47041300 | 2,1079695010 |
| 108 | 30/07/2020 | FI EM AÇÕES CAIXA IBRX ATIVO | 798.614,36 | 0,00 | 252.231,81664200 | 3,1661920000 |
| 97 | 31/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 59.577,44 | 0,00 | 28.261,55785600 | 2,1080734580 |

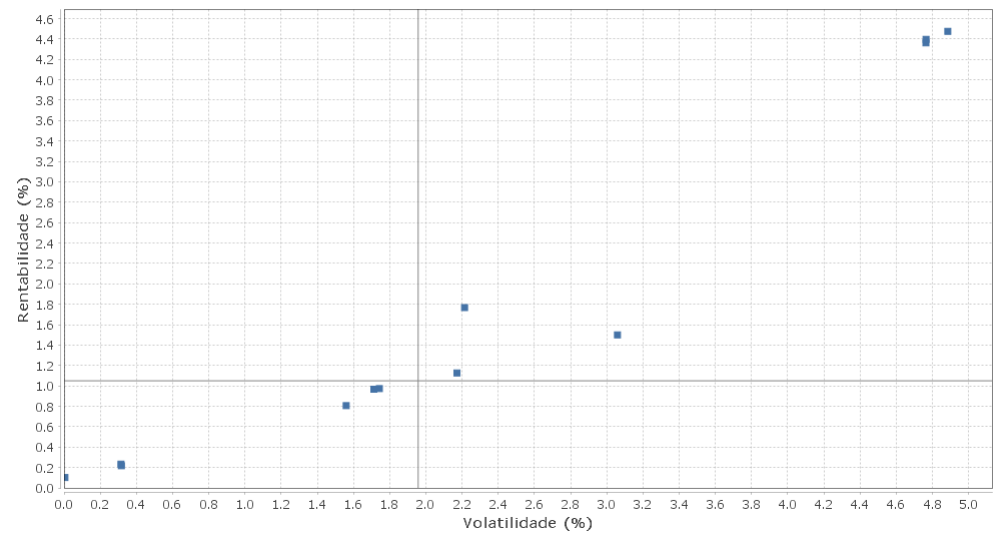
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

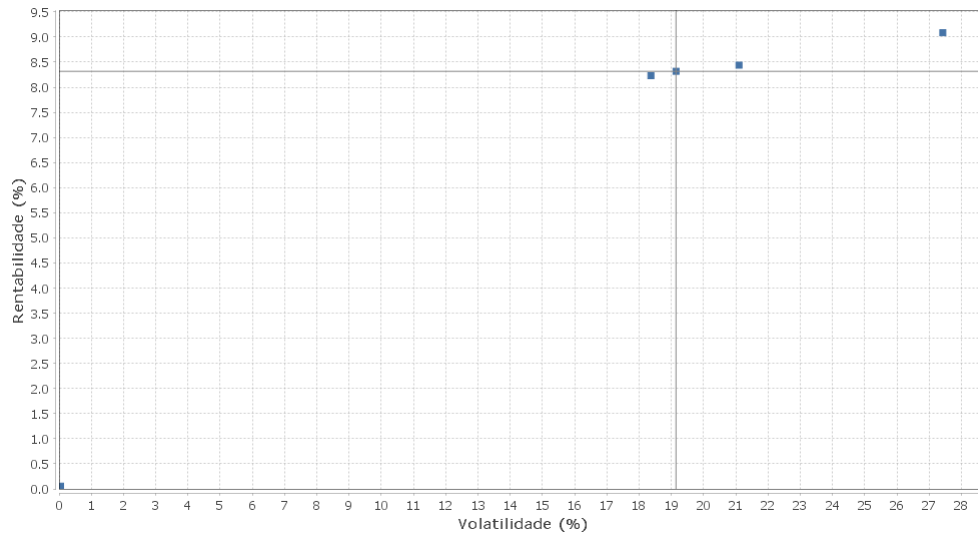
TAIÓ - No Mês



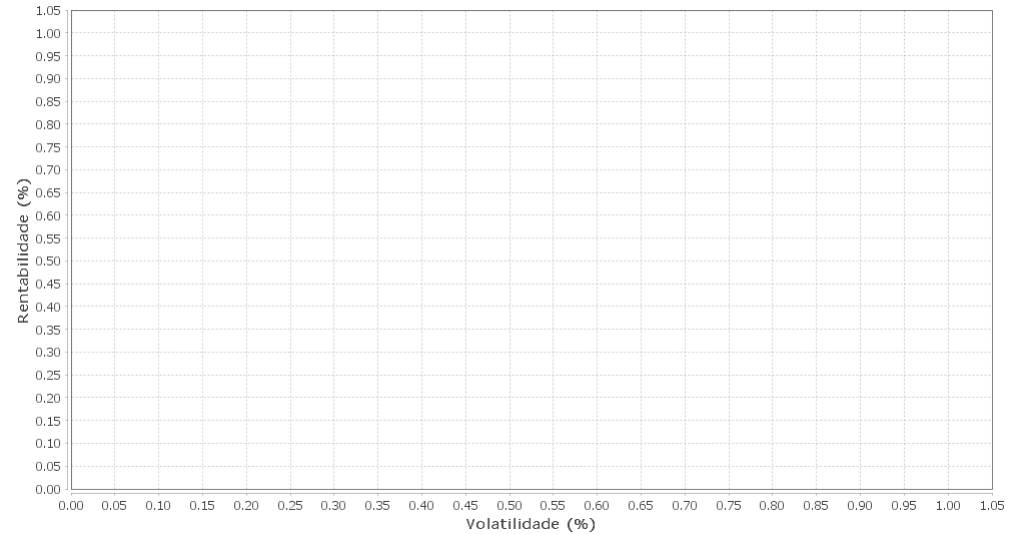
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-------------------------|--------------|------|-------|--------------|------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,00 | 0,00 | 0,10 | 238.094,58 | 0,54 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT | Artigo 8º III | 0,05 | 0,01 | 0,05 | 1.764.477,68 | 3,98 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 0,31 | 0,04 | 0,23 | 5.807.733,03 | 13,09 |
| BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | Artigo 7º I, Alínea b | 0,32 | 0,04 | 0,22 | 277.321,80 | 0,62 |
| BB PREV RF IDKA2 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,56 | 0,20 | 0,81 | 4.090.941,33 | 9,22 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,71 | 0,22 | 0,97 | 3.061.741,17 | 6,90 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,74 | 0,22 | 0,97 | 1.826.995,47 | 4,12 |
| BB PREV RF IRF-M | Artigo 7º I, Alínea b | 2,17 | 0,27 | 1,13 | 193.784,98 | 0,44 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,21 | 0,31 | 1,77 | 1.472.690,89 | 3,32 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO | Artigo 7º I, Alínea b | 3,06 | 0,38 | 1,50 | 623.120,30 | 1,40 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 4,76 | 0,68 | 4,36 | 5.586.200,45 | 12,59 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | Artigo 7º III, Alínea a | 4,76 | 0,68 | 4,40 | 7.584.854,11 | 17,09 |
| BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | Artigo 7º IV, Alínea a | 4,89 | 0,70 | 4,47 | 5.409.872,78 | 12,19 |
| BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | Artigo 8º II, Alínea a | 18,37 | 2,25 | 8,23 | 1.877.437,15 | 4,23 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 19,14 | 2,33 | 8,32 | 1.508.139,72 | 3,40 |
| FI EM AÇÕES CAIXA IBRX ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 21,10 | 2,54 | 8,44 | 1.753.130,85 | 3,95 |
| BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI | Artigo 8º II, Alínea a | 27,43 | 3,22 | 9,09 | 1.305.282,17 | 2,94 |