



LDB
EMPRESAS

TAIÓ
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 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

83,52%

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	5,84	0,77	4,68	3.964.420,97	9,36	5.220.862.294,67	0,08
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	5.794.237,05	13,68	7.792.694.548,07	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	1.681.493,29	3,97	5.526.503.185,82	0,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,53	0,26	2,44	276.720,03	0,65	980.825.577,34	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,10	3,04	1.809.379,52	4,27	8.746.335.681,60	0,02
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,10	1,21	2,88	4.058.205,86	9,58	6.212.458.601,64	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	8,67	1,02	5,88	613.916,29	1,45	2.971.560.297,96	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	1,08	3,08	3.032.410,95	7,16	4.025.627.854,04	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	1,75	1.447.109,34	3,42	10.783.491.196,95	0,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,28	0,89	2,77	22.677.893,30	53,54		

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	12,39	2,02	-1,86	7.357.842,82	17,37	2.894.677.261,07	0,25
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,39	2,02	-1,86	7.357.842,82	17,37		

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	12,96	2,09	-1,70	5.178.162,88	12,22	1.949.868.392,71	0,27
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,13	1,24	164.928,43	0,39	1.768.065.678,44	0,01
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			12,06	2,02	-1,86	5.343.091,31	12,61		
Renda Fixa			7,09	1,29	1,04	35.378.827,43	83,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,48%

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	42,99	8,50	-15,58	1.734.676,82	4,10	1.989.712.475,16	0,09
BB	BB	BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	45,53	12,81	-25,37	1.196.570,91	2,82	224.773.230,25	0,53
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	1.392.350,58	3,29	799.344.501,83	0,17
CEF	CEF	FI EM AÇÕES CAIXA IBRX ATIVO	43,66	9,32	11,66	893.415,66	2,11	131.419.339,40	0,68
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,03	8,51	-18,60	5.217.013,97	12,32		

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	1,77	0,11	1,79	1.763.512,26	4,16	507.594.109,51	0,35
Sub-total Artigo 8º III			1,77	0,11	1,79	1.763.512,26	4,16		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			28,04	6,25	-13,31	6.980.526,23	16,48		
Total						42.359.353,66	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	22.677.893,30	53,54	0,00	50,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	7.357.842,82	17,37	0,00	15,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	5.343.091,31	12,61	0,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	35.378.827,43	83,52				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.217.013,97	12,32	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.763.512,26	4,16	0,00	4,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	6.980.526,23	16,48				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

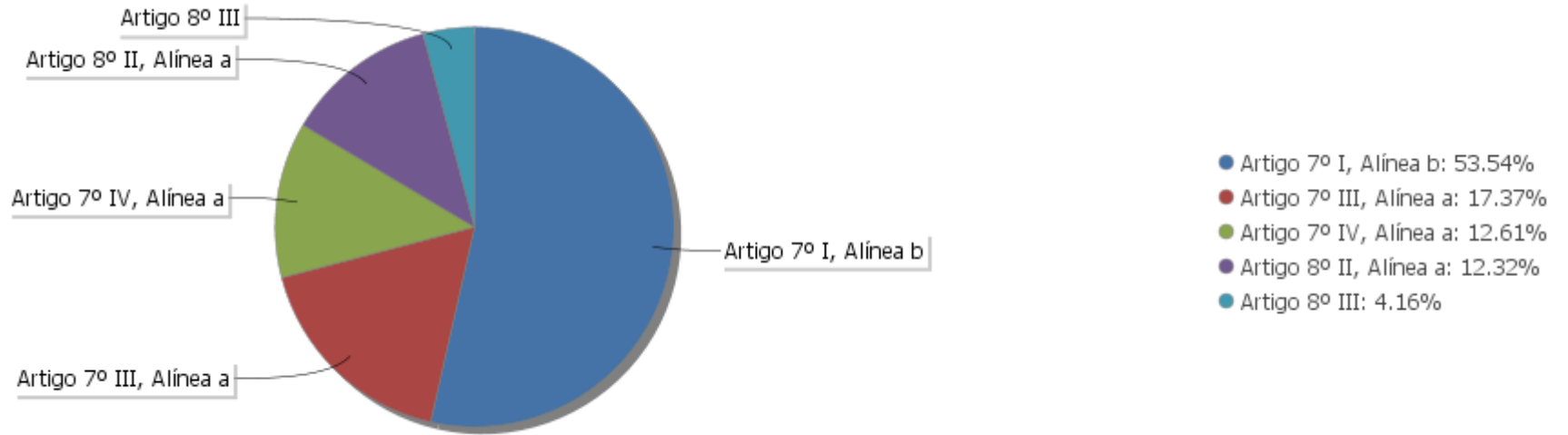
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,89 418,13	2,77 157,70	2,94 400,32	2,77 157,70	7,32 158,97	199.561,95	605.828,63
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,02 953,71	-1,86 -105,78	4,83 657,71	-1,86 -105,78	4,56 99,02	147.689,11	-150.572,81
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,02 951,50	-1,86 -106,20	4,73 643,26	-1,86 -106,20	3,90 84,64	106.328,06	-83.096,68
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,51 -0,25	-18,60 -0,79	25,71 -4,47	-18,60 -0,79	-1,33 4,52	408.928,03	-914.547,59
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,11 -8,65	1,79 19,60	0,62 -29,55	1,79 19,60	5,40 11,25	1.933,29	31.030,18
						864.440,44	-511.358,27

Análise de Liquidez

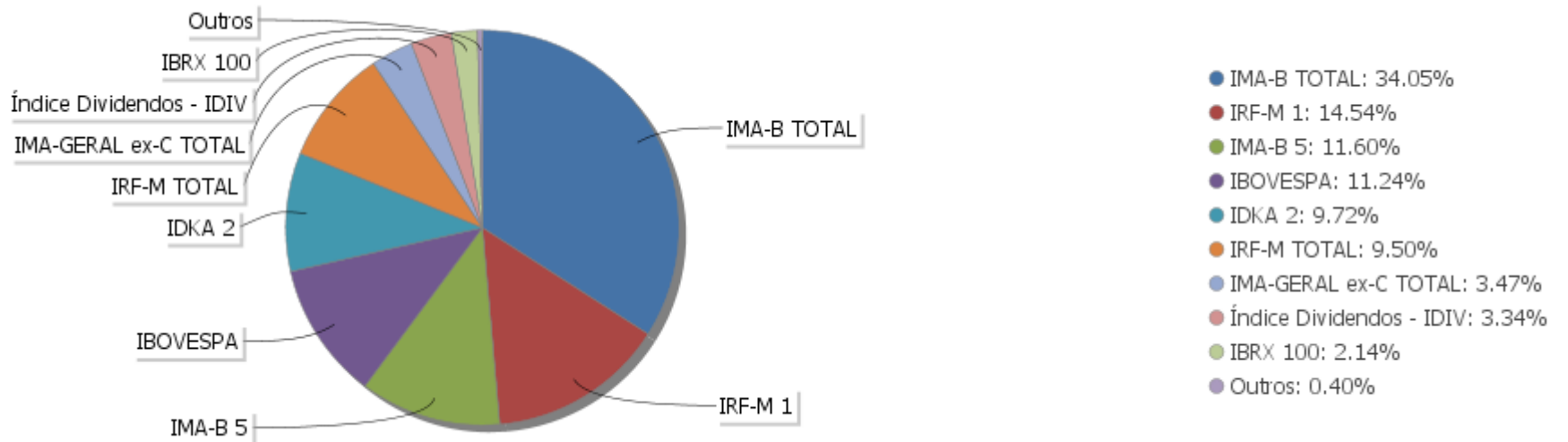
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	39.203.490,82	92,55	39.203.490,82	92,55
de 31 a 364 dias	3.155.862,84	7,45	42.359.353,66	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	42.359.353,66	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

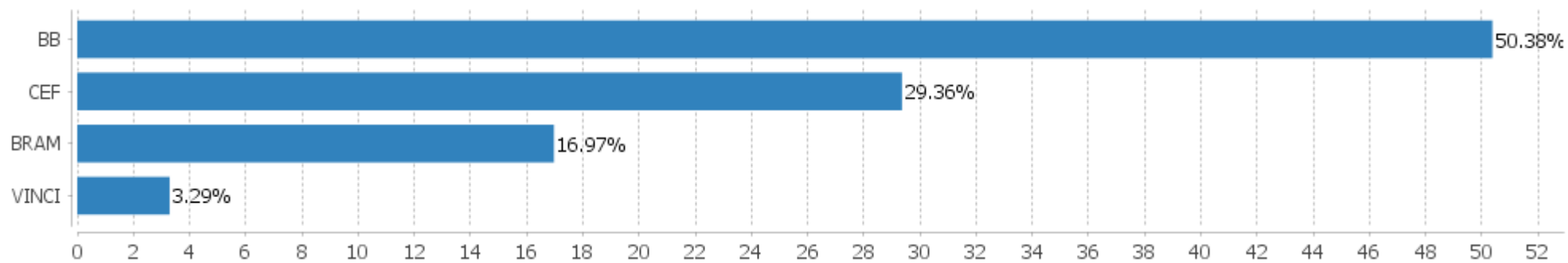


Alocação Por Estratégia



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							-1,26
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,93
p.p. indexador	-0,36	-1,07	-6,97	1,39	1,76	1,34							-4,19
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

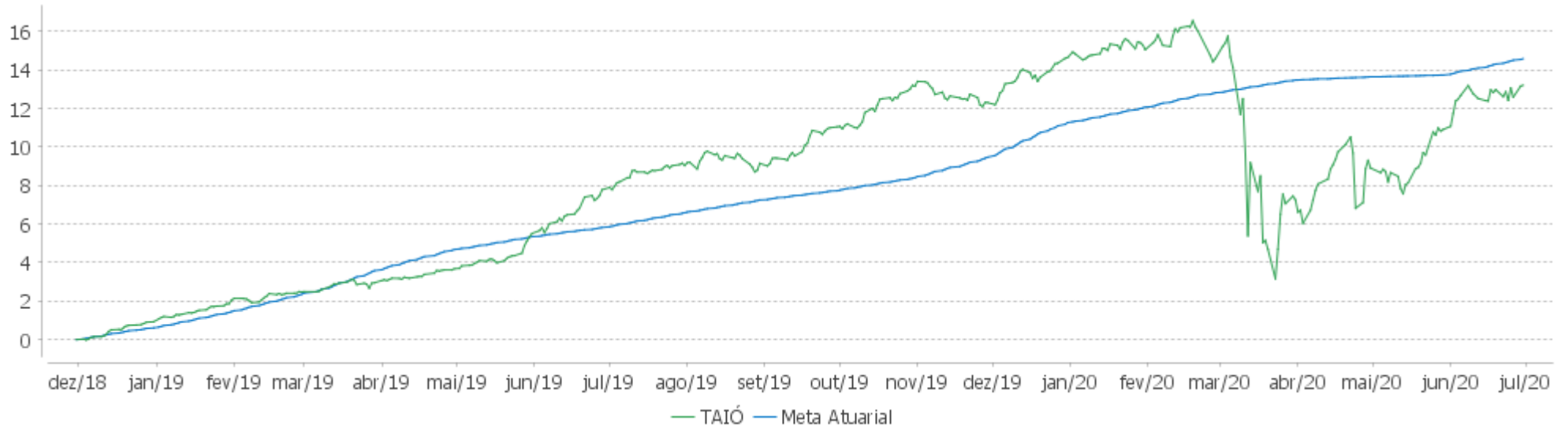
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

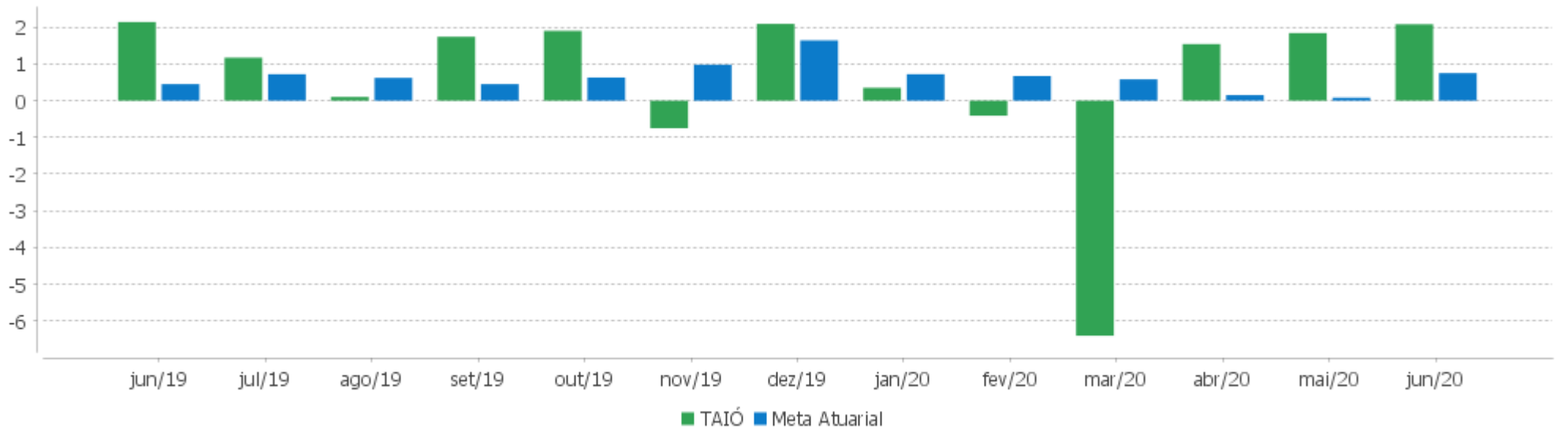
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	57,89	03 meses	5,55	0,96	4,59	8,77
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	42,11	06 meses	-1,26	2,93	-4,19	13,25
			12 meses	5,04	8,23	-3,19	9,42
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,14	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,40	2020-03	Desde 30/11/2018	13,21	14,53	-1,32	7,58

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.	1,02 -0,02	5,88 -0,15	4,41 -0,12	5,88 -0,15	11,53 -0,26	32,77 -0,47	44,55 -1,05
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 IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,21 0,22	2,88 -0,46	3,57 0,22	2,88 -0,46	8,18 -0,59	21,13 -2,04	32,87 -2,59
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	2,44 -0,16	1,07 -0,08	2,44 -0,16	5,70 -0,31	13,08 -0,59	21,64 -0,90
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 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 PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,77 -0,01	4,68 -0,18	3,26 -0,13	4,68 -0,18	9,51 -0,30	26,49 -0,59	37,50 -0,94
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
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,09 0,04	-1,70 -0,04	5,16 0,20	-1,70 -0,04	4,85 -0,10	35,14 0,01	45,86 -0,35
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,13 60,81	1,24 70,84	0,49 66,18	1,24 70,84	3,50 76,04	8,88 79,16	15,65 80,73
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,02	-1,86 -0,19	4,83 -0,13	-1,86 -0,19	4,56 -0,39	34,21 -0,92	44,88 -1,33
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	12,81 4,05	-25,37 -7,56	21,69 -8,49	-25,37 -7,56	-18,54 -12,69	30,16 -0,48	38,55 -12,57
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,58 -4,37	-16,79 1,59	20,57 1,87	-16,79 1,59	-2,34 -2,18	45,78 -1,73	57,70 -2,87
FI EM AÇÕES CAIXA IBRX ATIVO Var. IBRX 100 p.p.	9,32 0,35	-18,77 -1,38	30,16 -0,23	-18,77 -1,38	-5,40 -0,73		
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,50 -0,26	-15,58 2,22	31,97 1,79	-15,58 2,22	6,25 12,11	52,81 22,17	84,44 33,32
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	0,11	1,79	0,62	1,79	5,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-8,65	19,60	-29,55	19,60	11,25		
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

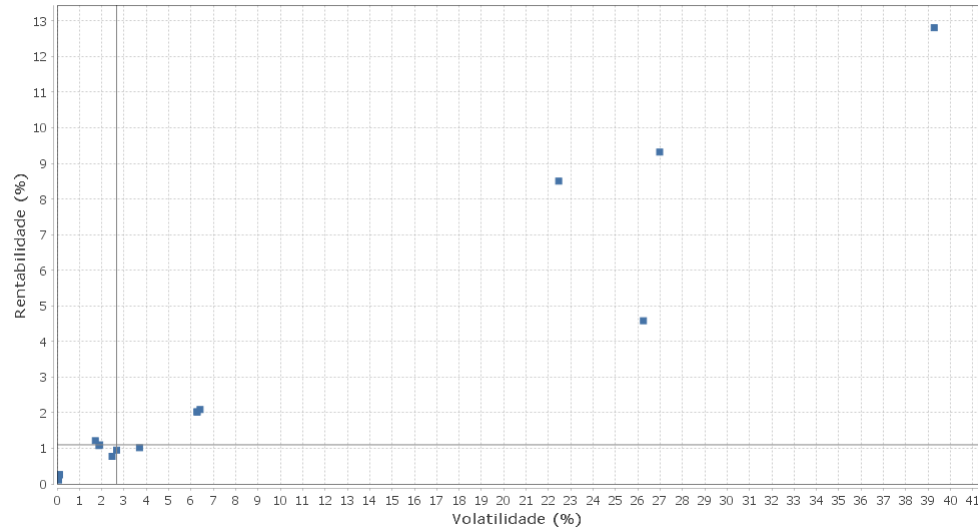
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
79	01/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.401,07	0,00	3.043,24390200	2,1033706810
80	03/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	127.811,04	0,00	60.755,87218700	2,1036820870
86	03/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.812,87	1.812,47443400	2,1036820870
81	04/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	141.057,13	0,00	67.047,70096700	2,1038324650
90	09/06/2020	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	0,00	210,76	58,14904500	3,6244790000
87	10/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	610,67	290,18217300	2,1044366520
82	16/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.664,12	0,00	790,59313500	2,1049006430
83	17/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.214,13	0,00	1.051,81829600	2,1050499010
88	17/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	64,99	30,87337700	2,1050499010
78	29/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	266.148,61	126.385,62280800	2,1058456182
85	29/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.030,43	0,00	4.288,26814200	2,1058454600
91	29/06/2020	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	0,00	95.217,63	26.222,92928400	3,6310830000
84	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.401,07	0,00	3.039,55047200	2,1059265370
89	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	20.000,00	0,00	9.497,00744400	2,1059265370

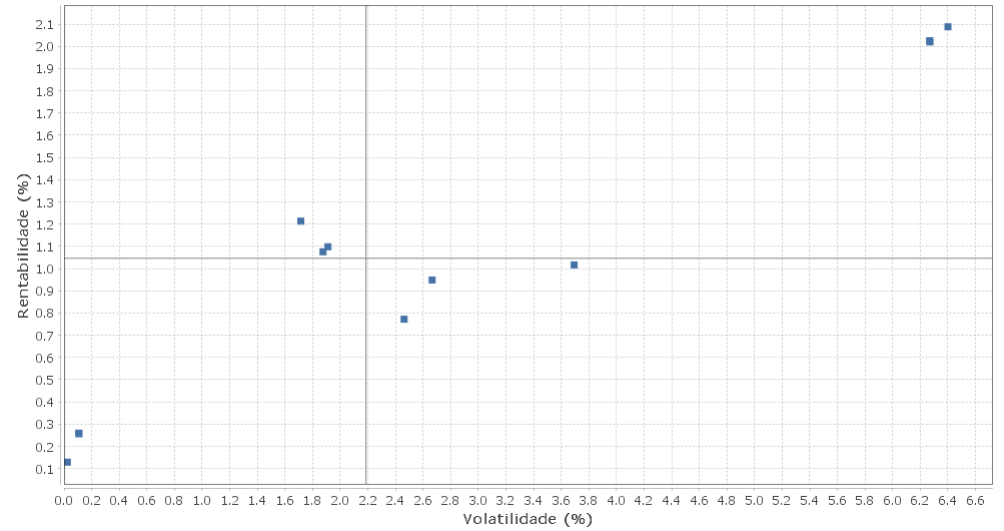
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

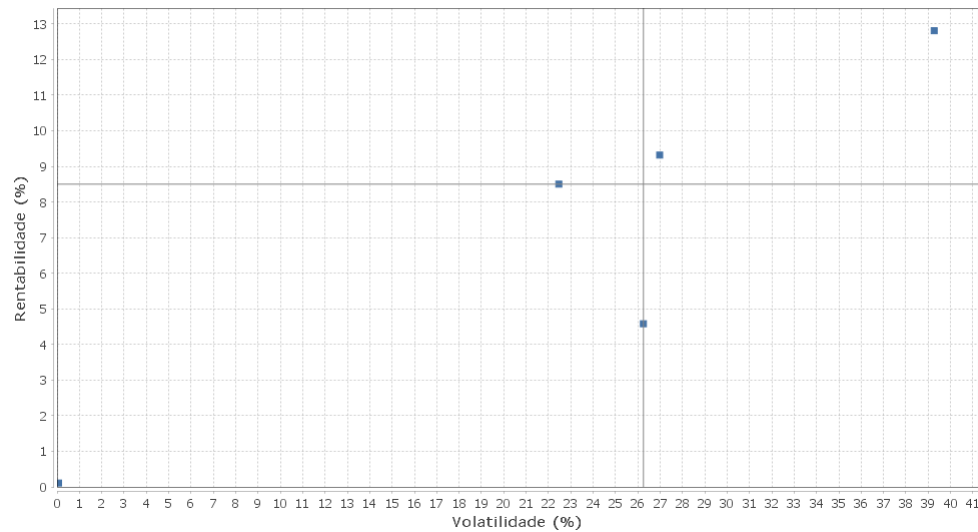
TAIÓ - No Mês



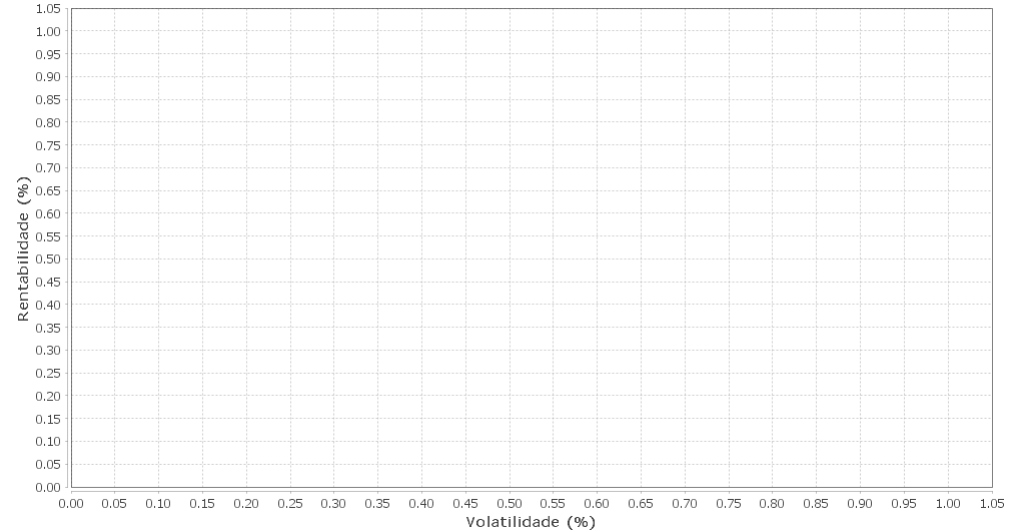
Renda Fixa - No Mês



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	0,02	0,01	0,13	164.928,43	0,39
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	Artigo 8º III	0,07	0,01	0,11	1.763.512,26	4,16
BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	276.720,03	0,65
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	5.794.237,05	13,68
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	0,24	1,21	4.058.205,86	9,58
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,88	0,25	1,08	3.032.410,95	7,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,25	1,10	1.809.379,52	4,27
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	0,29	0,77	3.964.420,97	9,36
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	0,32	0,95	1.447.109,34	3,42
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	0,43	1,02	613.916,29	1,45
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	6,27	0,74	2,02	7.357.842,82	17,37
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	0,74	2,02	1.681.493,29	3,97
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,40	0,76	2,09	5.178.162,88	12,22
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,46	2,72	8,50	1.734.676,82	4,10
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	2,93	4,58	1.392.350,58	3,29
FI EM AÇÕES CAIXA IBRX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	26,98	3,22	9,32	893.415,66	2,11
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	39,27	4,64	12,81	1.196.570,91	2,82