LDB
EMPRESAS

CAMPINAS CONSOLIDADO

MAIO 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 29.05.2020.

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 **78,54%**

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	0,54	0,39	2,19	6.117.560,09	0,68	7.581.218.915,05	0,08
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,41	1,50	-3,69	57.105.175,31	6,35	5.454.809.775,70	1,05
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,41	1,49	-3,79	60.809.085,67	6,76	736.279.311,90	8,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,39	2,22	1.497.336,81	0,17	10.824.772.393,85	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00	2,11	1,92	78.979.481,82	8,79	8.882.233.150,63	0,89
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,00	1,00	-7,95	37.080.355,66	4,13	1.970.647.318,20	1,88
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,02	2,13	2,01	23.637.209,66	2,63	919.612.145,87	2,57
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,97	2,11	1,99	49.500.826,45	5,51	4.431.593.608,10	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,34	1,25	0,64	5.456.140,44	0,61	676.970.933,69	0,81
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,07	0,79	95.826.175,60	10,66	10.653.642.517,78	0,90
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,48	1,92	1,85	15.535.303,89	1,73	522.957.884,47	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,74	0,04	3,03	14.220.120,00	1,58	82.579.504,63	17,22
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**8,11**	**1,52**	**-0,89**	**445.764.771,40**	**49,59**		

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
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,11	161.900.079,73	18,01	2.574.764.271,12	6,29
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,10	1,75	-3,50	29.082.535,26	3,24	784.739.833,59	3,71
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,37	2,16	2,12	6.712.381,43	0,75	889.703.632,35	0,75
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,92	0,54	1,82	26.771.407,93	2,98	5.202.369.354,06	0,51
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	6,11	2,19	-1,28	9.872.217,36	1,10	535.038.387,72	1,85
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	**2,44**	**0,59**	**0,29**	**234.338.621,71**	**26,07**		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	GENIAL	FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER III	361,69	-4,07	43,14	9.032,09	0,00	942.089,73	0,96
VOTORANTIM	VOTORANTIM	FIDC SANASA	7,26	0,58	5,71	4.668.844,65	0,52	156.401.327,20	2,99
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	112,61	10,31	-2,70	27.011,84	0,00	3.695.750,72	0,73
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a	**7,13**	**0,62**	**5,85**	**4.704.888,58**	**0,52**		

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
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,46	2,17	1,68	2.242.068,96	0,25	594.877.546,04	0,38
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	5,95	2,19	-0,20	12.953.187,42	1,44	553.692.031,39	2,34
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,54	0,57	-3,51	5.811.976,56	0,65	89.178.220,65	6,52
QUELUZ	BNY MELLON	URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV	5,79	-2,11	-15,43	185.196,62	0,02	1.250.016,56	14,82
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b	**4,20**	**1,70**	**-1,54**	**21.192.429,56**	**2,36**		
		Renda Fixa	**6,19**	**1,20**	**-0,58**	**706.000.711,25**	**78,54**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 20,06%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	42,94	8,49	-24,27	28.441.167,97	3,16	577.291.375,77	4,93
		Sub-total Artigo 8º I, Alinea a	**42,94**	**8,49**	**-24,27**	**28.441.167,97**	**3,16**		

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	BRADESCO F I A SELECTION	42,78	7,86	-30,73	16.047.306,56	1,79	640.262.757,81	2,51
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,20	5,82	-25,90	25.892.530,14	2,88	1.455.929.520,62	1,78
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,23	5,79	-26,59	9.016.640,72	1,00	1.070.014.738,46	0,84
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	44,90	10,28	-16,87	19.652.982,74	2,19	1.808.642.265,33	1,09
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,60	8,34	-23,61	24.193.816,73	2,69	926.402.790,16	2,61
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	42,96	7,16	-20,56	12.673.052,24	1,41	942.047.097,60	1,35
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,12	7,48	-17,27	8.273.073,46	0,92	710.762.724,82	1,16
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	62,71	5,83	-28,76	7.124.121,08	0,79	156.660.768,16	4,55
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	48,03	8,28	-20,96	7.903.799,58	0,88	760.668.702,33	1,04
		Sub-total Artigo 8º II, Alínea a	**42,04**	**7,57**	**-24,65**	**130.777.323,25**	**14,55**		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT	2,99	0,39	-0,50	4.395.748,96	0,49	216.762.317,34	2,03
MAUA	BTG PACTUAL	MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	4,44	1,45	0,20	6.223.722,89	0,69	244.892.284,08	2,54
XP	BNY MELLON	XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	5,74	2,53	-1,17	4.460.486,80	0,50	424.551.868,48	1,05
		Sub-total Artigo 8º III	**3,91**	**1,45**	**-0,41**	**15.079.958,65**	**1,68**		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RJI	RJI	FIP LSH - MULTIESTRATÉGIA	0,23	-0,04	-0,22	3.947.551,28	0,44	110.653.034,81	3,57
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a	**0,23**	**-0,04**	**-0,22**	**3.947.551,28**	**0,44**		

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	VOTORANTIM	RBRD11	46,07	2,49	-27,02	2.033.708,71	0,23	178.605.637,09	1,14
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	**46,07**	**2,49**	**-27,02**	**2.033.708,71**	**0,23**		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	**37,13**	**6,93**	**-22,66**	**180.279.709,86**	**20,06**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 1,41%

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
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,19	5,57	26,36	12.635.714,83	1,41	235.083.784,18	5,37
		Sub-total Artigo 9º A, II	**29,19**	**5,57**	**26,36**	**12.635.714,83**	**1,41**		
		Investimentos no Exterior	**38,94**	**5,57**	**26,36**	**12.635.714,83**	**1,41**		
		Total	**11,47**	**2,33**	**-5,71**	**898.916.135,94**	**100,00**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**Limite Legal**
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	445.764.771,40	49,59	30,00	51,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	234.338.621,71	26,07	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	4.704.888,58	0,52	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	21.192.429,56	2,36	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	**706.000.711,25**	**78,54**				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	28.441.167,97	3,16	0,00	4,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	130.777.323,25	14,55	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.079.958,65	1,68	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.947.551,28	0,44	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.033.708,71	0,23	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	**180.279.709,86**	**20,06**				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	12.635.714,83	1,41	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	**12.635.714,83**	**1,41**				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

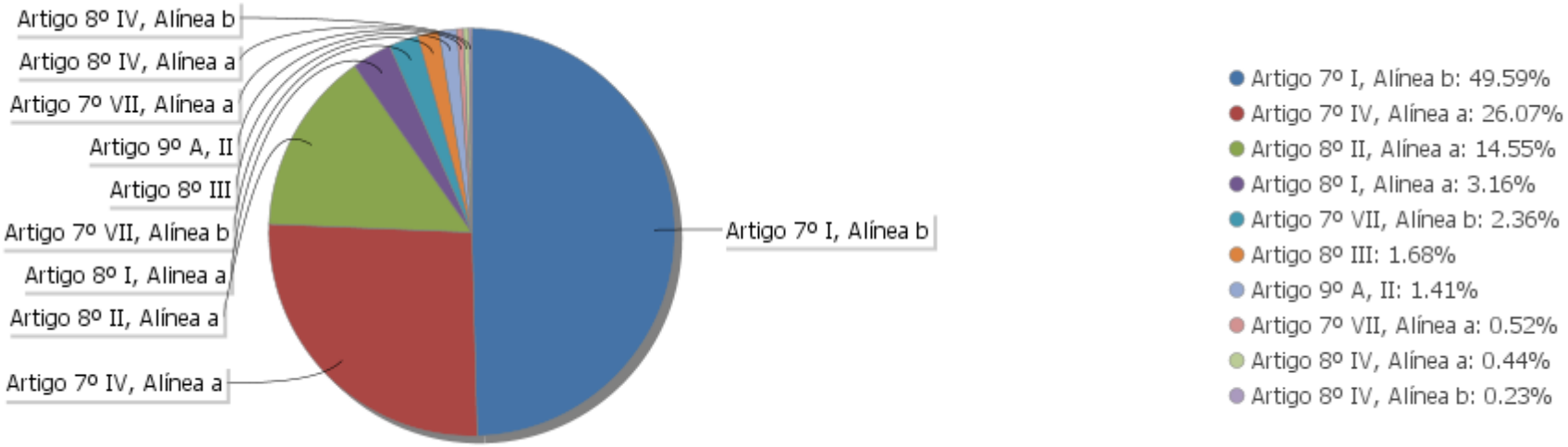
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,52 643,06	-0,89 -57,61	-1,67 -193,41	0,83 43,15	8,06 165,57	6.658.517,09	-3.856.842,08
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,59 248,19	0,29 18,74	-0,39 -45,17	0,67 35,16	4,22 86,72	1.420.771,64	1.272.152,44
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,62 264,76	5,85 380,34	2,82 326,83	7,32 381,60	8,58 176,22	31.038,53	289.601,63
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,70 721,51	-1,54 -99,93	-2,30 -267,34	-0,93 -48,66	3,69 75,75	354.533,35	-433.958,61
Artigo 8º I, Alinea a Var. IBOVESPA p.p.	8,49 -0,08	-24,27 0,15	-16,01 0,08	-19,09 0,16	-9,96 -0,04	2.225.860,28	-9.114.335,43
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,57 -1,00	-24,65 -0,23	-18,72 -2,62	-18,54 0,70	-7,23 2,69	9.200.287,86	-40.594.964,94
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,45 -7,11	-0,41 24,01	-0,51 15,59	0,97 20,22	5,34 15,27	216.142,08	-62.766,31
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,04 -8,61	-0,22 24,20	-0,13 15,97	-0,25 19,00	-0,53 9,40	-1.734,82	-8.850,98
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,49 -6,08	-27,02 -2,60	-8,86 7,24	-26,31 -7,06	-19,05 -9,12	49.378,89	-776.109,35
Artigo 9º A, II % do CDI	5,57 2.363,50	26,36 3.243,05				667.050,48	2.635.714,83
CAMPINAS CONSOLIDADO (Total)						**20.821.845,38**	**-50.650.358,80**

Análise de Liquidez

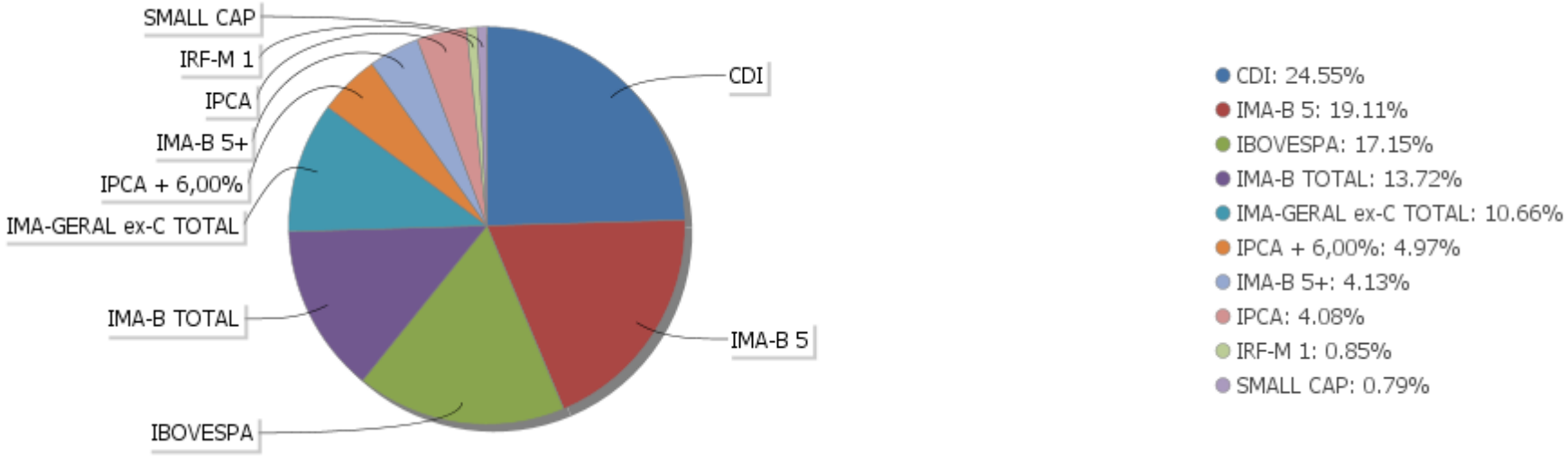
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	784.606.018,16	87,28	784.606.018,16	87,28
de 31 a 365 dias	76.644.276,03	8,53	861.250.294,19	95,81
acima de 365 dias	37.665.841,75	4,19	898.916.135,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

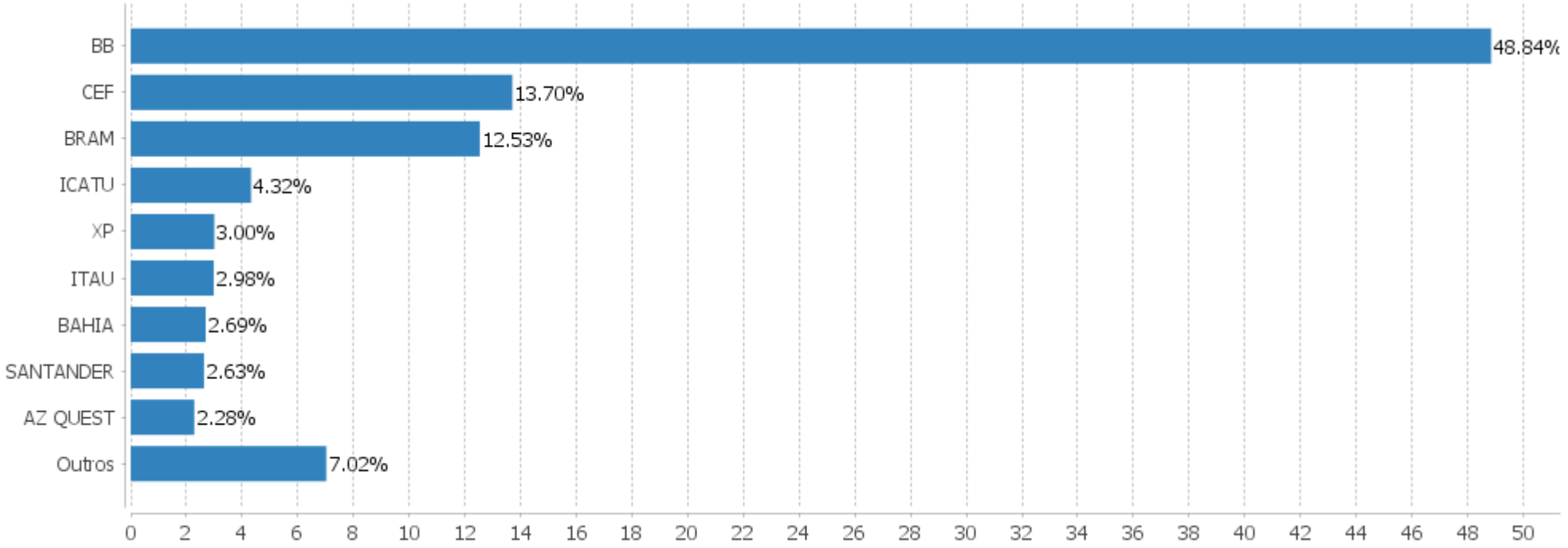


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,28	-1,11	-9,36	2,51	2,33								-5,71
IPCA + 4,00%	0,55	0,53	0,41	0,00	-0,07								1,44
p.p. indexador	-0,27	-1,64	-9,77	2,51	2,40								-7,15
2019	2,30	0,36	0,55	0,99	2,45	2,67	1,09	0,05	2,12	2,30	-1,00	2,52	17,59
IPCA + 4,00%	0,66	0,74	1,05	0,90	0,47	0,31	0,55	0,45	0,29	0,46	0,82	1,48	8,50
p.p. indexador	1,63	-0,38	-0,49	0,09	1,97	2,36	0,54	-0,40	1,83	1,85	-1,83	1,04	9,10

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

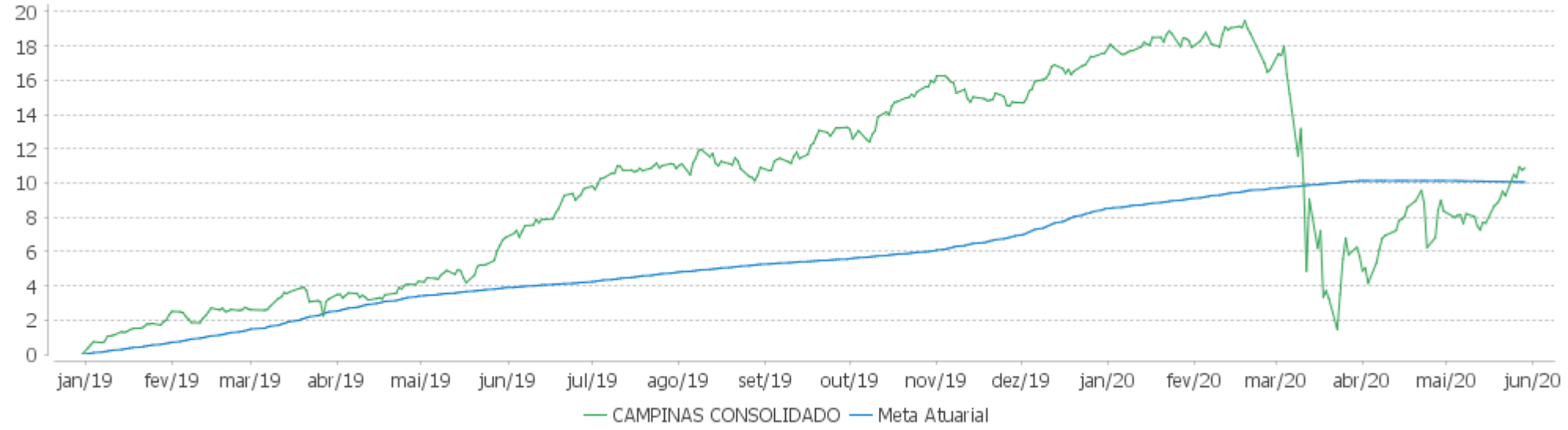
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima da Meta Atuarial	10	58,82
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	41,18

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,67	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-9,36	2020-03

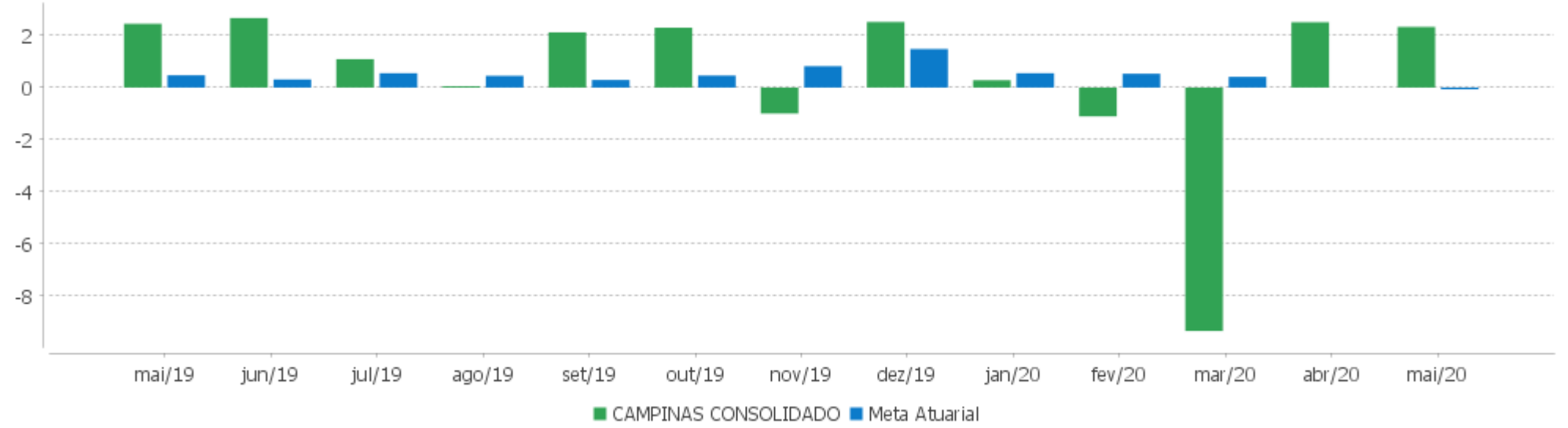
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-4,92	0,34	-5,26	21,82
06 meses	-3,33	2,94	-6,27	15,85
12 meses	3,81	5,94	-2,13	11,47
24 meses				
36 meses				
Desde 31/12/2018	10,88	10,05	0,82	9,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,16	2,12	0,89	3,37	9,44	23,69	35,60
Var. IMA-B 5 p.p.	0,04	0,09	0,07	0,08	-0,02	-0,24	-0,49
BRADESCO H FI RF NILO	1,75	-3,50	-4,38	-1,52	7,49	33,68	48,30
% do CDI	744,21	-227,36	-508,59	-79,31	153,79	291,59	240,30
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,26	1,11	0,48	1,47	4,27	10,77	19,35
% do CDI	108,46	72,02	55,88	76,39	87,61	93,25	96,29
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,54	1,82	1,22	2,17	7,84	19,42	32,39
Var. IPCA p.p.	0,92	1,99	1,84	1,19	5,96	12,80	22,72
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	2,19	0,66	-0,61	1,95	8,03		
Var. IPCA p.p.	2,57	0,82	0,01	0,97	6,15		
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2,19	-0,20	-1,71	0,97	6,00	20,26	33,25
Var. IMA-B 5 p.p.	0,07	-2,23	-2,52	-2,32	-3,46	-3,67	-2,85
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV	-2,11	-15,43	-10,66	-17,66	-26,78	-50,20	
% do CDI	-896,73	-1.002,97	-1.237,33	-920,16	-549,85	-434,60	
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,17	1,68	0,52	2,80	8,29	23,00	37,20
Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,09	-0,54	-0,29	-1,10	0,32	3,25	6,73
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,57	-3,51	-3,96	-3,25	-1,04	5,65	14,17
% do CDI	242,70	-227,89	-459,84	-169,19	-21,30	48,92	70,49
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,04	3,03	1,18	4,41	5,29	17,15	23,86
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05	0,81	0,36	0,51	-2,68	-2,59	-6,61
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,11	1,92	0,74	3,15	9,15	23,37	35,19
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,11	-0,08	-0,14	-0,31	-0,56	-0,90
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,13	2,01	0,83	3,25	9,29	23,49	35,36
Var. IMA-B 5 p.p.	0,01	-0,02	0,01	-0,04	-0,17	-0,44	-0,74
BB PREV RF VII	1,25	0,64	0,03	1,57	6,31	18,52	30,05
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,27	4,28	4,35	3,27	-0,37	-13,48	-13,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,07	0,79	-0,15	1,76	7,59	22,37	33,47
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,10	-0,00	0,00	0,05	0,17	0,40	0,42
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,92	1,85	0,63	3,00	8,95	30,82	42,32
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,84	-0,37	-0,18	-0,90	0,99	11,08	11,86
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,39	2,19	1,41	2,60	6,04	13,42	22,44
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,12	-0,07	-0,14	-0,28	-0,55	-0,85
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,11	1,99	0,77	3,20	9,26	23,45	35,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,04	-0,05	-0,09	-0,20	-0,48	-0,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,39	2,22	1,42	2,63	6,11	13,55	22,63
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,09	-0,05	-0,11	-0,21	-0,42	-0,66
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,50	-3,69	-4,36	-1,79	6,48	31,36	42,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,06	-0,04	-0,09	-0,20	-0,64	-1,05
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1,49	-3,79	-4,42	-1,88	6,32	31,05	41,84
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,15	-0,10	-0,18	-0,36	-0,94	-1,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,00	-7,95	-8,27	-5,45	4,09	37,43	46,99
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,03	-0,07	-0,06	0,04	-0,07	-0,65	-1,05
FIDC ITALIA SENIOR	10,31	-2,70	2,76	-0,97	29,88	1.674,97	191.154,12
% do CDI	4.372,59	-175,40	320,71	-50,56	613,45	14.499,92	951.003,88
FIDC SANASA	0,58	5,71	2,65	6,99	7,72	25,17	32,44
% do CDI	247,01	370,86	307,80	364,12	158,59	217,88	161,41
FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER III	-4,07	43,14	23,38	206,73	810,78	157,51	461,18
% do CDI	-1.727,67	2.803,71	2.713,78	10.771,25	16.645,76	1.363,54	2.294,38
RBRD11	2,49	-27,02	-8,86	-26,31	-19,05	6,98	
Var. IBOVESPA p.p.	-6,08	-2,60	7,24	-7,06	-9,12	-6,89	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,28	-16,87	-12,27	-10,89	3,46	41,18	67,32
Var. IBOVESPA p.p.	1,71	7,55	3,83	8,35	13,39	27,31	27,94
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	7,16	-20,56	-13,25	-13,38	0,13	32,07	86,32
Var. IBOVESPA p.p.	-1,40	3,86	2,85	5,87	10,06	18,20	46,94
BRADESCO F I A SELECTION	7,86	-30,73	-21,10	-25,75	-17,66	4,91	43,56
Var. IBOVESPA p.p.	-0,71	-6,31	-5,01	-6,50	-7,74	-8,97	4,18
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	8,34	-23,61	-17,12	-17,24	-7,03	16,64	50,16
Var. IBOVESPA p.p.	-0,23	0,81	-1,02	2,01	2,89	2,77	10,79
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	5,83	-27,12	-27,02				
Var. SMALL CAP p.p.	0,76	3,61	-2,20				
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	5,79	-26,59	-26,64	-18,65	4,15	30,60	76,97
Var. IBOVESPA p.p.	-2,78	-2,17	-10,55	0,60	14,07	16,72	37,60
INDIE FIC FIA	8,28	-21,79	-18,28	-11,26	8,50		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,29	2,63	-2,18	7,98	18,43		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	5,82	-25,90	-20,82	-20,34	-8,74	28,96	46,25
Var. IBOVESPA p.p.	-2,75	-1,48	-4,72	-1,09	1,18	15,08	6,88
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7,48	-23,74	-15,01	-17,02	-8,97	29,31	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,08	0,68	1,09	2,22	0,96	15,44	
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	8,49	-24,27	-16,01	-19,09	-9,96	13,28	37,64

Carteira: CAMPINAS CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/05/2020

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.	-0,08	0,15	0,08	0,16	-0,04	-0,60	-1,73
FIP LSH - MULTIESTRATÉGIA	-0,04	-0,22	-0,13	-0,25	-0,53	-1,04	
% do CDI	-18,63	-14,54	-15,28	-12,90	-10,81	-8,96	
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT	0,39	-0,50	-1,92	1,45	5,36	11,28	23,57
% do CDI	166,33	-32,62	-222,44	75,41	110,02	97,66	117,27
MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	1,45	0,20	0,61	1,42	6,54	14,74	
% do CDI	614,43	12,98	70,86	74,11	134,25	127,60	
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	2,53	-1,17	-0,64	-0,10	4,44	12,38	23,48
% do CDI	1.073,07	-76,30	-74,00	-5,34	91,19	107,14	116,82
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5,57	41,04	33,59	37,84			
Var. IPCA + 6,00% p.p.	5,49	38,82	32,77	33,94			
CAMPINAS CONSOLIDADO	2,33	-5,71	-4,92	-3,33	3,81		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	2,40	-7,15	-5,26	-6,27	-2,13		
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6,00%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6,00%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	3,59	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	0,80	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
Renda Variável							
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,94	6,51	14,65	19,54
SELIC	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,56	20,12
Meta Atuarial							

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
219	05/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.000,00	2.646,37940900	2,2672485960
216	05/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.821,26469700	2,2672485960
217	05/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	787.000,00	347.116,76584100	2,2672485960
218	05/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	27.000,00	11.908,70734100	2,2672485960
220	08/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.500,00	1.542,75913700	2,2686620000
221	08/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.000,00	3.085,51827400	2,2686620000
222	08/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.250.000,00	0,00	1.873.350,38082400	2,2686626290
223	08/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	875.000,00	385.689,78428700	2,2686626290
224	08/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	22.000,00	9.697,34314800	2,2686620000
225	08/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	52.000,00	22.920,99289500	2,2686626290
226	11/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.300.000,00	0,00	3.217.133,80380800	2,2691005240
227	11/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	180.000,00	79.326,58694300	2,2691005240
234	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.405,64044100	2,2698175520
228	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.433,84264400	2,2698175520
229	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	160.000,00	70.490,24705000	2,2698175520
230	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	66.000,00	29.077,22690800	2,2698175520
231	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.650.000,00	2.048.622,80490400	2,2698175520
232	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	105.000,00	46.259,22462700	2,2698175520
233	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.405,64044100	2,2698175520
235	18/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.798.000,00	3.435.027,19449100	2,2701421440
236	18/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.270.000,00	0,00	3.202.442,63964400	2,2701421440
242	20/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.560.000,00	0,00	4.650.421,55602300	2,2707618810
237	20/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.325.373,30	0,00	583.668,99281200	2,2707618810
238	20/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.300.000,00	0,00	6.737.826,68628400	2,2707618810
239	20/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	72.000,00	31.707,41970000	2,2707618810
240	20/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.281.878,61	0,00	564.514,76516500	2,2707618810
241	20/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.480.000,00	0,00	651.763,62717000	2,2707618810
243	27/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	530.000,00	233.248,52549000	2,2722544500

Carteira: CAMPINAS CONSOLIDADO

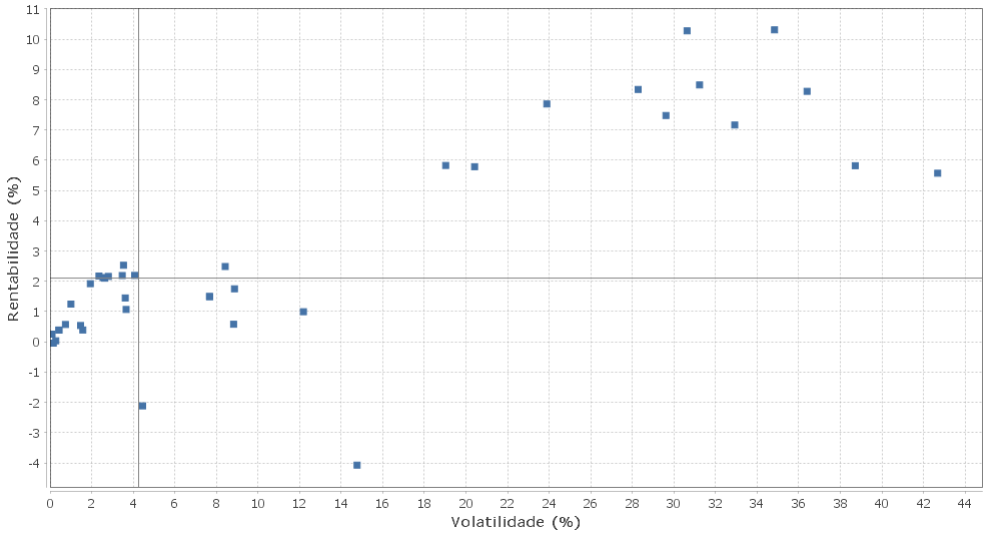
Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

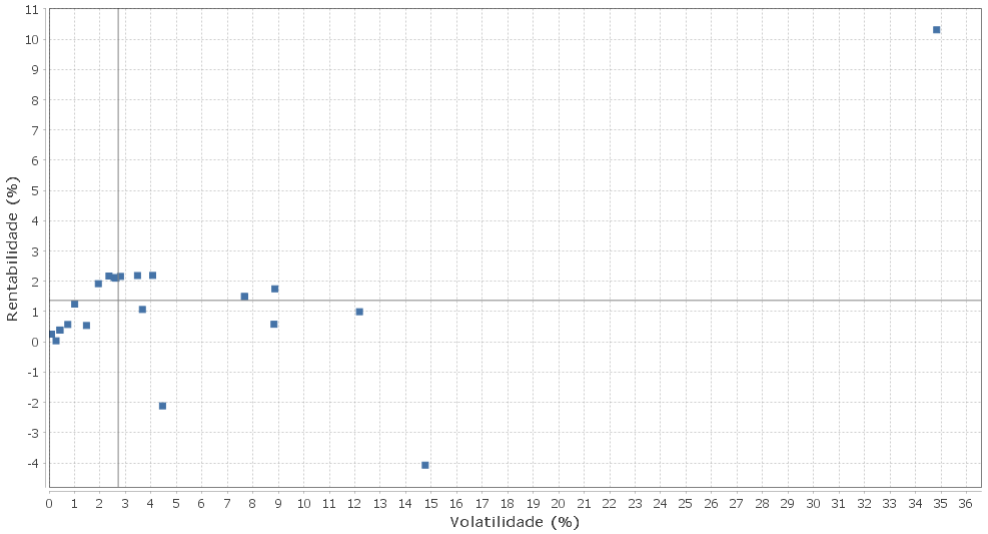
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
252	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	451.000,00	198.460,28072000	2,2724950220
244	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	335.744,10	147.742,48979500	2,2724952075
245	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	986.671,01	434.179,61335400	2,2724950220
246	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.139.383,75	501.380,08619200	2,2724950220
247	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.881,82	44.392,53854300	2,2724950220
248	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.803,14778300	2,2724950220
249	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	23.000.000,00	10.121.034,27173100	2,2724950220
250	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	305.000,00	134.213,71534300	2,2724950220
251	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	215.000,00	94.609,66819200	2,2724950220
254	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.396.200,00	0,00	614.323,22638900	2,2727449330
255	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.713,73	0,00	2.514,02166400	2,2727449330
256	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.106,82	0,00	4.446,96624400	2,2727449330
257	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.373,89	0,00	2.804,48980700	2,2727449330
258	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	222.939,58	0,00	98.092,65296900	2,2727449330
259	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.799,93162000	2,2727449330
260	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.173,13	0,00	8.436,11164700	2,2727449330
261	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	33.164,18	0,00	14.592,12581100	2,2727449330
253	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	612.882,12	0,00	269.666,03735400	2,2727449330
	Total					

Risco - Dispersão

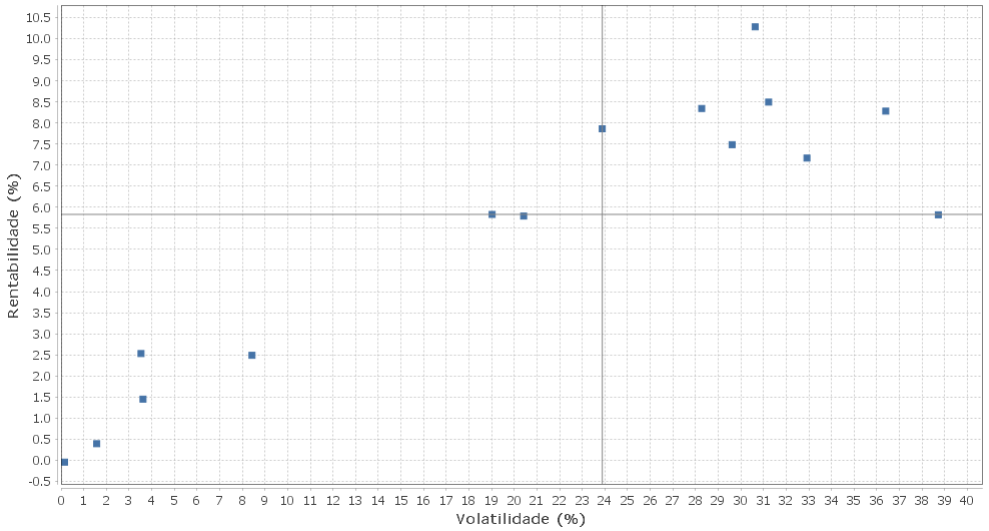
CAMPINAS CONSOLIDADO - No Mês



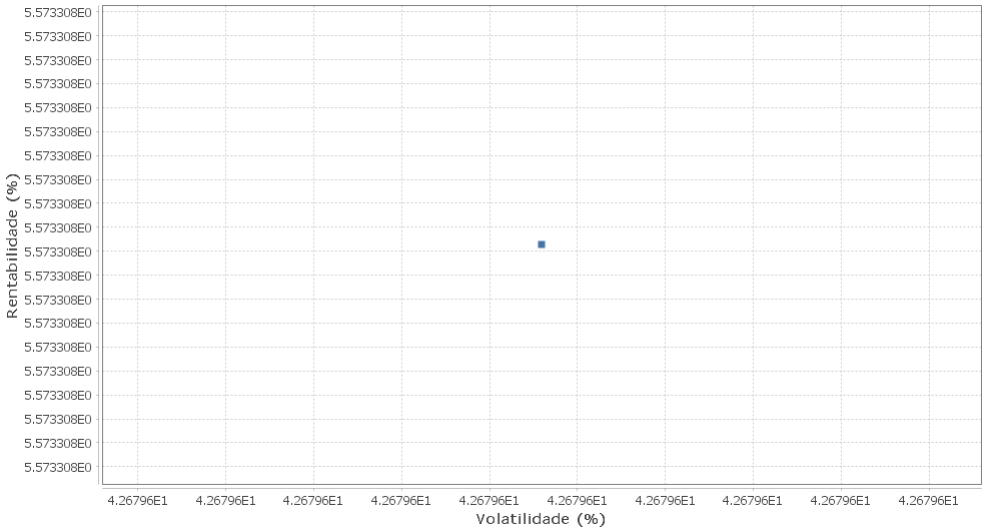
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 73.159.173,23** **Value-At-Risk: 8,14%**

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,11	-0,00	0,20	0,26	161.900.079,73	18,01
FIP LSH - MULTIESTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,16	0,01	0,00	-1,79	-0,04	3.947.551,28	0,44
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,27	0,22	-0,00	-0,73	0,04	14.220.120,00	1,58
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,32	0,00	0,36	0,39	6.117.560,09	0,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,32	0,00	0,37	0,39	1.497.336,81	0,17
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,74	1,51	0,00	0,46	0,57	5.811.976,56	0,65
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	1,59	0,01	1,01	1,25	5.456.140,44	0,61
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,47	0,54	0,01	0,21	0,54	26.771.407,93	2,98
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT	Artigo 8º III	1,57	1,34	0,00	0,10	0,39	4.395.748,96	0,49
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	2,38	0,03	0,87	1,92	15.535.303,89	1,73
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,35	2,79	0,01	0,82	2,17	2.242.068,96	0,25
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	2,86	0,06	0,74	2,13	23.637.209,66	2,63
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,62	2,38	0,11	0,72	2,11	49.500.826,45	5,51
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,63	2,87	0,21	0,71	2,11	78.979.481,82	8,79
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,80	3,03	0,02	0,69	2,16	6.712.381,43	0,75
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	3,47	3,59	0,04	0,56	2,19	12.953.187,42	1,44
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	Artigo 8º III	3,53	3,69	0,02	0,65	2,53	4.460.486,80	0,50
MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	Artigo 8º III	3,62	3,65	0,02	0,34	1,45	6.223.722,89	0,69
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,66	3,93	0,38	0,23	1,07	95.826.175,60	10,66
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	4,07	4,00	0,04	0,48	2,19	9.872.217,36	1,10
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV	Artigo 7º VII, Alínea b	4,45	0,39	0,00	-0,53	-2,11	185.196,62	0,02
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	9,52	0,55	0,17	1,50	57.105.175,31	6,35
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	7,68	9,73	0,60	0,16	1,49	60.809.085,67	6,76
RBRD11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,43	1,95	0,00	0,27	2,49	2.033.708,71	0,23
FIDC SANASA	Artigo 7º VII, Alínea a	8,83	0,36	-0,00	0,04	0,58	4.668.844,65	0,52
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	8,87	11,25	0,33	0,17	1,75	29.082.535,26	3,24
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	12,18	14,31	0,54	0,06	1,00	37.080.355,66	4,13
FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER III	Artigo 7º VII, Alínea a	14,76	1,64	-0,00	-0,29	-4,07	9.032,09	0,00

Carteira: CAMPINAS CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,02	27,05	0,20	0,29	5,83	7.124.121,08	0,79
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,42	28,23	0,27	0,27	5,79	9.016.640,72	1,00
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	23,88	29,91	0,51	0,32	7,86	16.047.306,56	1,79
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,27	29,72	0,77	0,29	8,34	24.193.816,73	2,69
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,61	30,13	0,27	0,24	7,48	8.273.073,46	0,92
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,63	29,72	0,62	0,33	10,28	19.652.982,74	2,19
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alinea a	31,23	31,53	0,96	0,26	8,49	28.441.167,97	3,16
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,92	32,38	0,44	0,21	7,16	12.673.052,24	1,41
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	34,83	0,13	0,00	0,29	10,31	27.011,84	0,00
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	36,40	31,82	0,26	0,22	8,28	7.903.799,58	0,88
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	38,71	29,83	0,82	0,14	5,82	25.892.530,14	2,88
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	42,68	16,67	0,04	0,13	5,57	12.635.714,83	1,41