



**LDB**  
EMPRESAS

**CAMPINAS CONSOLIDADO**  
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 23.02.2021.

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

76,75%

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	0,23	2,69	6.147.549,98	0,64	7.835.713.656,67	0,08
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,47	4,36	2,54	60.799.939,64	6,32	5.823.784.558,48	1,04
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,48	4,35	2,43	64.740.137,51	6,73	783.279.334,63	8,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,24	2,73	1.504.836,79	0,16	10.907.406.871,77	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,97	4,05	80.624.548,29	8,38	12.027.903.790,65	0,67
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,21	7,28	1,51	40.892.911,23	4,25	2.088.485.812,29	1,96
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	4,97	0,97	4,10	24.123.108,61	2,51	1.087.480.106,37	2,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,97	4,08	50.517.277,69	5,25	4.153.926.563,49	1,22
BB	BB	BB PREV RF VII	2,29	0,32	1,97	5.527.919,68	0,57	685.876.947,75	0,81
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	98.445.326,73	10,23	10.799.663.748,52	0,91
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,41	0,69	3,73	15.821.588,16	1,64	532.594.941,61	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,73	0,86	4,40	14.409.300,00	1,50	83.678.080,03	17,22
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>8,10</b>	<b>2,54</b>	<b>3,07</b>	<b>463.554.444,31</b>	<b>48,17</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
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	6,11	1,98	2,14	10.213.837,77	1,06	481.380.309,42	2,12
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>6,11</b>	<b>1,98</b>	<b>2,14</b>	<b>10.213.837,77</b>	<b>1,06</b>		

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	0,24	1,61	175.421.049,99	18,23	2.412.408.451,26	7,27
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,15	4,62	3,26	31.119.831,95	3,23	894.303.423,23	3,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRDESCO	BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,32	0,97	4,24	6.851.631,53	0,71	831.066.921,71	0,82
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,64	0,55	2,83	27.036.373,10	2,81	5.186.154.771,17	0,52
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,30</b>	<b>0,84</b>	<b>1,74</b>	<b>240.428.886,57</b>	<b>24,99</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	GENIAL	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	357,38	-13,62	16,94	7.378,83	0,00	769.647,01	0,96
VOTORANTIM	VOTORANTIM	FIDC SANASA	7,40	0,98	7,25	4.576.060,84	0,48	154.319.070,78	2,97
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	112,14	-0,10	10,61	30.705,71	0,00	4.205.147,95	0,73
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>7,26</b>	<b>0,95</b>	<b>7,44</b>	<b>4.614.145,38</b>	<b>0,48</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
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,46	0,98	3,69	2.286.247,64	0,24	606.599.266,38	0,38
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	5,93	1,93	3,21	13.395.661,17	1,39	628.743.407,57	2,13
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,55	0,97	-1,95	3.880.623,29	0,40	93.619.779,01	4,15
QUELUZ	BNY MELLON	URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV	5,72	-3,52	-21,16	172.662,92	0,02	1.165.418,07	14,82
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>4,19</b>	<b>1,58</b>	<b>1,19</b>	<b>19.735.195,02</b>	<b>2,05</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>6,15</b>	<b>1,94</b>	<b>2,48</b>	<b>738.546.509,05</b>	<b>76,75</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,79%

## 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
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESA	43,54	8,14	-11,05	33.404.933,70	3,47	692.799.908,03	4,82
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>43,54</b>	<b>8,14</b>	<b>-11,05</b>	<b>33.404.933,70</b>	<b>3,47</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
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	43,38	10,05	-16,95	19.240.347,88	2,00	711.621.761,40	2,70
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,76	4,36	-16,57	29.154.360,88	3,03	1.602.131.208,86	1,82
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,92	14,10	-9,01	11.176.410,07	1,16	1.311.663.407,89	0,85
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,16	8,38	-0,65	23.486.932,86	2,44	2.366.861.217,15	0,99
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,13	10,35	-8,92	28.844.610,52	3,00	1.108.758.492,93	2,60
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	43,69	8,78	-6,42	14.929.853,74	1,55	1.102.899.208,45	1,35
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,86	6,38	-5,45	9.455.264,91	0,98	921.115.521,73	1,03
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	55,35	13,85	-11,97	8.803.104,63	0,91	320.862.225,06	2,74
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	48,39	8,13	-3,67	9.632.635,91	1,00	967.255.409,32	1,00
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>42,54</b>	<b>8,75</b>	<b>-10,86</b>	<b>154.723.521,40</b>	<b>16,08</b>		

## 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	2,93	0,20	-0,77	4.383.891,48	0,46	222.669.540,94	1,97
MAUA	BTG PACTUAL	MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	4,40	0,83	2,14	6.344.201,35	0,66	265.791.870,05	2,39
XP	BNY MELLON	XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	5,81	1,44	2,37	4.620.630,60	0,48	411.390.622,76	1,12
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>3,90</b>	<b>0,83</b>	<b>1,36</b>	<b>15.348.723,43</b>	<b>1,60</b>		

## 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	0,22	-0,04	-0,31	3.944.075,70	0,41	110.555.611,43	3,57
		<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>	<b>0,22</b>	<b>-0,04</b>	<b>-0,31</b>	<b>3.944.075,70</b>	<b>0,41</b>		
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	59,29	-4,64	-5,55	2.251.731,35	0,23	150.023.338,76	1,50
		<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>	<b>59,29</b>	<b>-4,64</b>	<b>-5,55</b>	<b>2.251.731,35</b>	<b>0,23</b>		
		<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>37,63</b>	<b>7,71</b>	<b>-9,85</b>	<b>209.672.985,58</b>	<b>21,79</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,46%

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	29,78	3,31	40,57	14.056.859,83	1,46	430.849.446,69	3,26
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>29,78</b>	<b>3,31</b>	<b>40,57</b>	<b>14.056.859,83</b>	<b>1,46</b>		
Investimentos no Exterior			35,95	3,31	40,57	14.056.859,83	1,46		
<b>Total</b>			<b>11,55</b>	<b>3,17</b>	<b>-0,15</b>	<b>962.276.354,46</b>	<b>100,00</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	463.554.444,31	48,17	30,00	51,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	10.213.837,77	1,06	0,00	0,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	240.428.886,57	24,99	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	4.614.145,38	0,48	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	19.735.195,02	2,05	0,00	1,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>738.546.509,05</b>	<b>76,75</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	33.404.933,70	3,47	0,00	4,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	154.723.521,40	16,08	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.348.723,43	1,60	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.944.075,70	0,41	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.251.731,35	0,23	0,00	1,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>209.672.985,58</b>	<b>21,79</b>				30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	14.056.859,83	1,46	0,00	2,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>14.056.859,83</b>	<b>1,46</b>				10,00



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

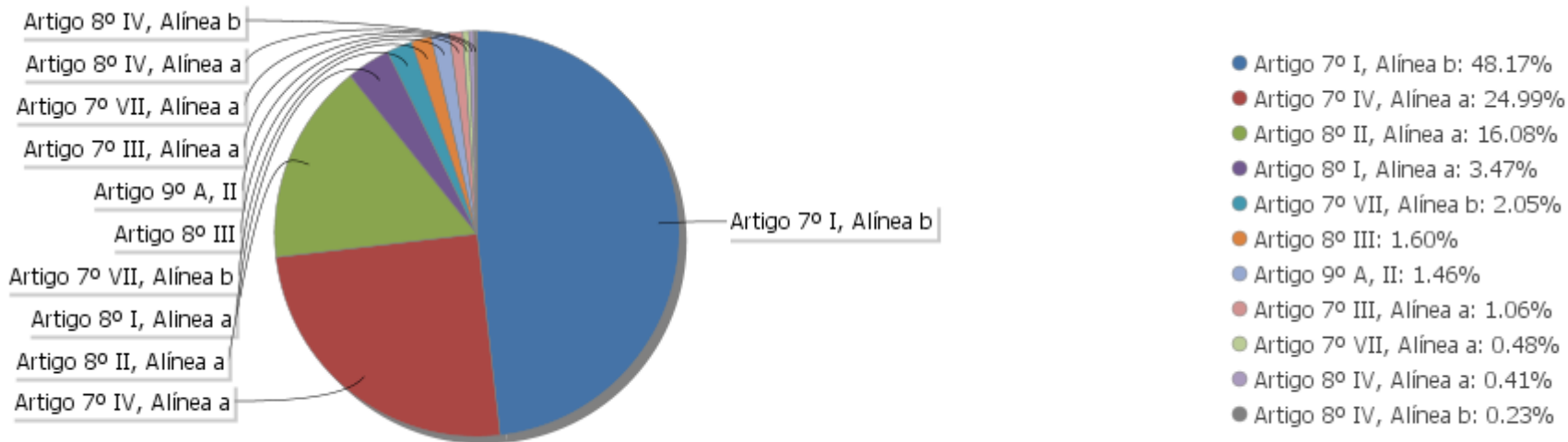
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,54 1.307,30	3,07 157,21	5,57 864,76	2,72 173,40	8,07 191,45	11.485.248,53	13.932.830,83
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,98 1.018,77	2,14 172,53	5,73 890,08			198.293,69	213.837,77
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,84 431,07	1,74 89,12	1,92 298,94	1,39 88,57	4,05 95,98	2.014.266,81	4.712.276,20
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,95 487,38	7,44 380,87	2,13 330,62	5,52 351,81	7,98 189,22	44.647,97	360.746,93
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,58 812,83	1,19 60,87	4,52 701,58	0,61 39,07	4,40 104,50	306.899,46	108.806,85
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,14 -0,12	-11,05 -0,04	27,43 -0,41	-9,54 -0,01	0,90 -0,18	2.515.104,77	-4.150.569,70
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,75 0,48	-10,86 0,15	27,26 -0,57	-11,17 -1,63	3,04 1,96	12.442.861,58	-16.648.766,79
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,83 -7,43	1,36 12,37	3,26 -24,57	0,87 10,41	5,01 3,93	126.980,06	205.998,47
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,04 -8,31	-0,31 10,70	-0,13 -27,96	-0,27 9,27	-0,51 -1,59	-1.740,76	-12.326,56
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-4,64 -12,90	-5,55 5,46	32,64 4,81	-5,30 4,23	0,97 -0,11	-54.419,32	-113.765,75
Artigo 9º A, II % do CDI	3,31 1.701,41	40,57 3.316,83	17,45 2.709,83			449.915,30	4.056.859,83
<b>CAMPINAS CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>29.528.058,09</b>	<b>2.665.928,08</b>

## Análise de Liquidez

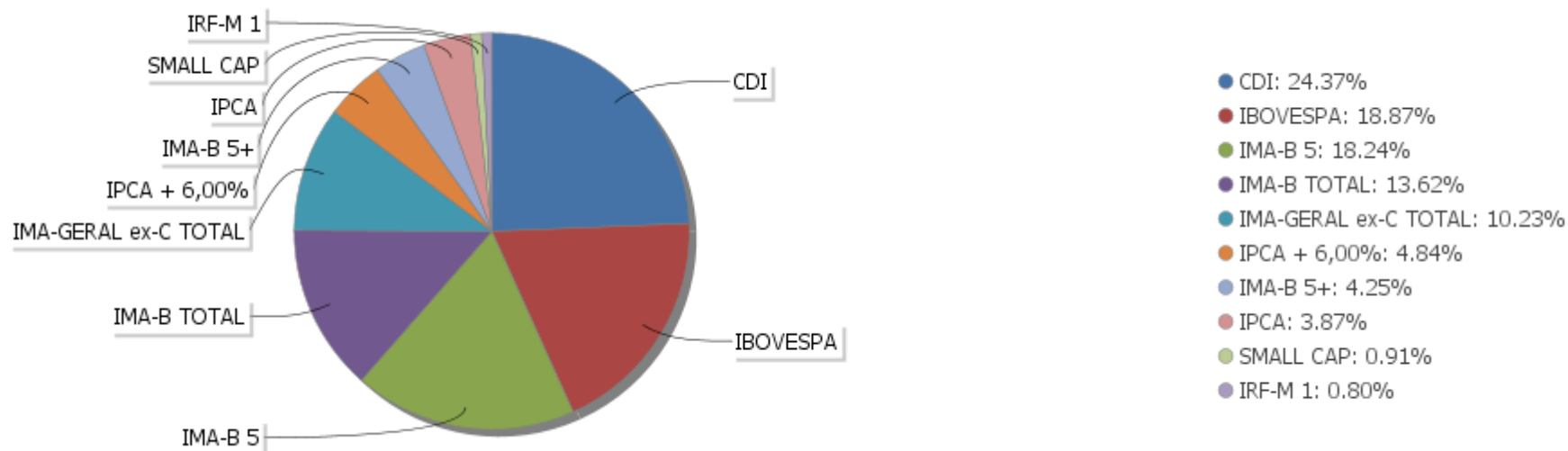
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	837.678.632,41	87,05	837.678.632,41	87,05
de 31 a 365 dias	86.349.297,94	8,97	924.027.930,35	96,03
acima de 365 dias	38.248.424,11	3,97	962.276.354,46	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

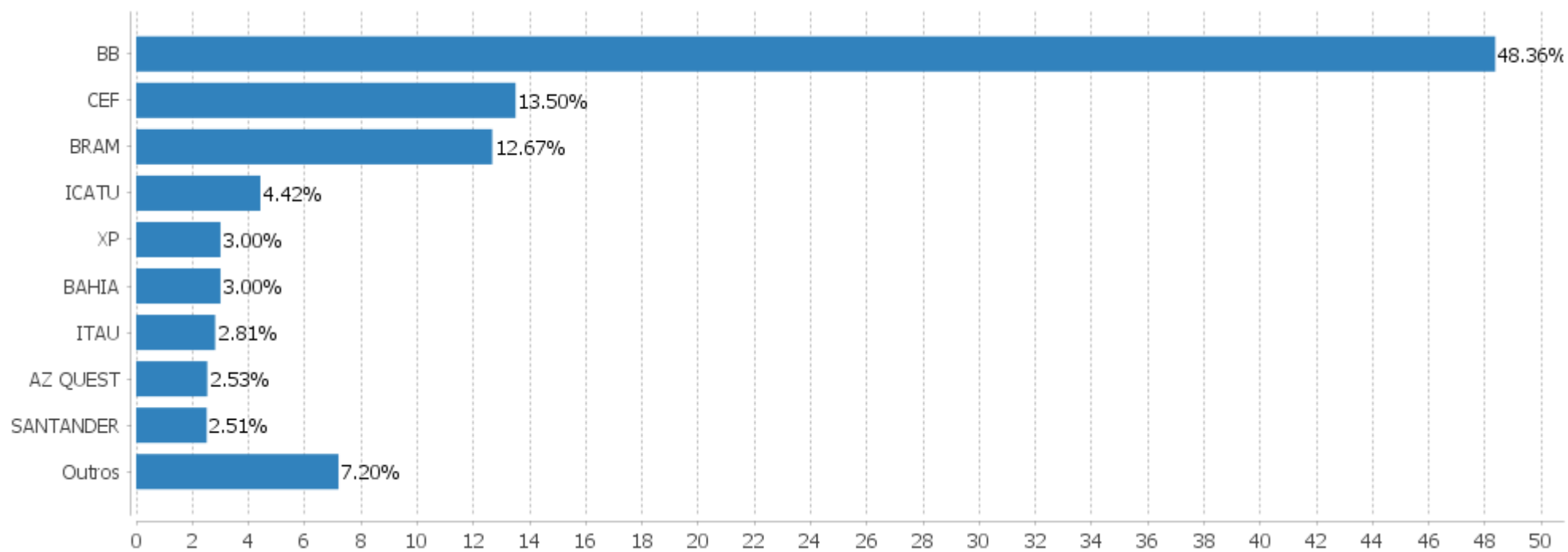


Alocação Por Estratégia



## 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	0,28	-1,11	-9,36	2,51	2,33	2,64	3,17						-0,15
IPCA + 4,00%	0,55	0,53	0,41	0,00	-0,07	0,59	0,72						2,77
p.p. indexador	-0,27	-1,64	-9,77	2,51	2,40	2,05	2,45						-2,92
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

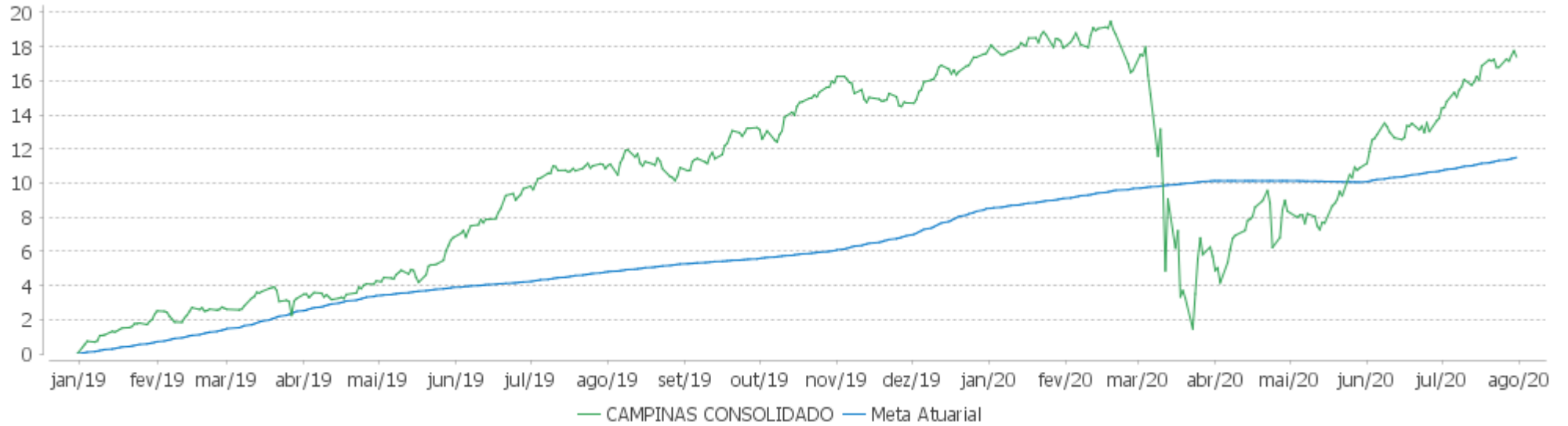
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

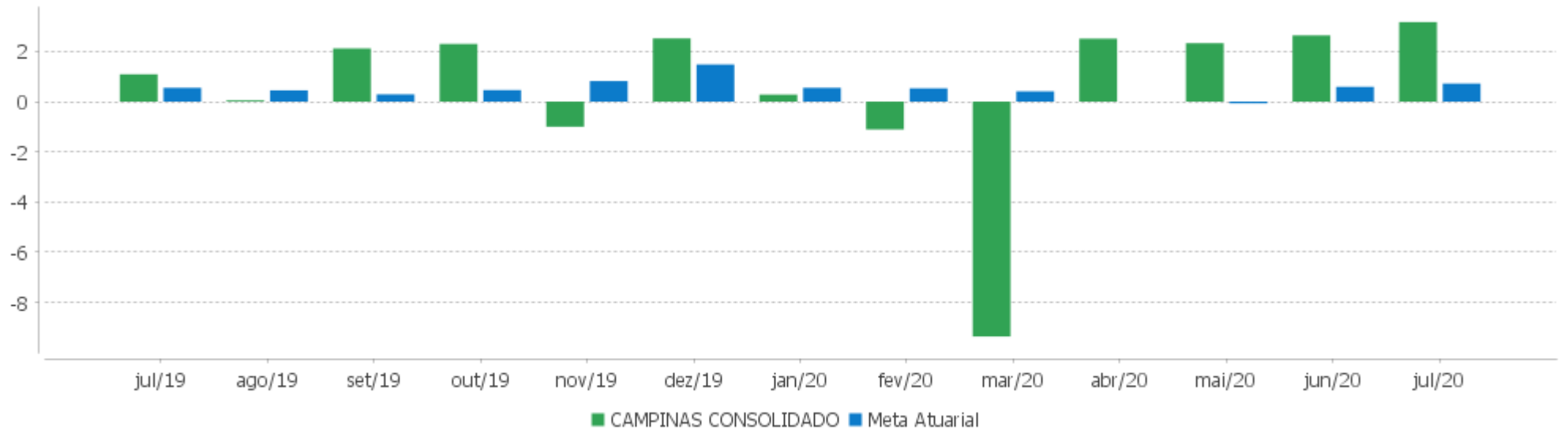
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	63,16	03 meses	8,36	1,24	7,12	5,72
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	36,84	06 meses	-0,43	2,20	-2,63	15,97
			12 meses	5,92	6,41	-0,50	11,55
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,17	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-9,36	2020-03	Desde 31/12/2018	17,41	11,50	5,92	9,42

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
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,10 -48,99	10,61 543,35	25,40 3.944,40	14,58 929,17	31,45 746,30	2.567,49 23.711,43	219.806,01 1.176.915,41
FIDC SANASA % do CDI	0,98 505,03	7,25 371,53	2,05 318,93	5,26 334,95	7,16 169,90	23,02 212,57	34,82 186,43
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	-13,63 -7.011,49	16,94 867,86	-21,63 -3.359,89	48,08 3.063,30	1.294,35 30.710,82	132,98 1.228,10	422,72 2.263,41
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP Var. IPCA p.p.	1,98 1,62	4,14 3,68	5,73 5,49	3,42 3,17	8,66 6,35		
BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,24 0,05	4,28 -0,00	3,66 0,04	8,77 -0,06	23,92 -0,24	33,83 -0,60
BRDESCO H FI RF NILO % do CDI	4,62 2.378,09	3,26 167,08	8,88 1.379,68	2,88 183,29	8,89 210,89	40,64 375,34	51,94 278,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 121,46	1,61 82,50	0,75 117,07	1,26 80,04	3,74 88,70	10,19 94,14	18,03 96,53
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,55 0,19	2,83 2,37	1,54 1,30	2,48 2,23	5,21 2,90	19,22 13,62	29,15 18,81
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,86 -0,04	4,40 0,49	1,37 -0,37	3,05 -0,11	5,51 -2,96	15,56 -3,06	24,43 -6,89
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
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,10 -0,09	4,23 -0,06	3,54 -0,07	8,64 -0,19	23,68 -0,47	33,67 -0,76
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,32 -4,07	1,97 -0,68	2,58 -5,56	1,77 -0,61	5,74 -2,41	18,19 -19,68	27,84 -18,91
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
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,69 -0,21	3,73 -0,18	3,80 2,07	3,16 0,00	8,11 -0,36	24,59 5,96	43,70 12,38
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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	2,73	0,90	2,30	5,30	12,79	20,92

## 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.	0,00	-0,11	-0,04	-0,09	-0,21	-0,41	-0,64
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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,35 -0,03	2,43 -0,22	8,05 -0,09	2,19 -0,19	7,79 -0,37	36,89 -0,97	45,24 -1,51
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	7,28 -0,05	1,51 -0,16	11,38 -0,12	1,46 -0,18	7,68 -0,13	48,58 -0,79	54,96 -1,23
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	1,93 0,94	3,21 -0,98	5,68 1,40	2,24 -1,37	6,89 -1,94	21,94 -2,21	33,31 -1,12
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV % do CDI	-3,52 -1.812,50	-21,16 -1.083,78	-8,74 -1.357,35	-18,97 -1.208,52	-29,17 -692,05	-56,99 -526,31	
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,98 0,09	3,69 -0,22	4,19 2,45	2,83 -0,33	8,10 -0,37	22,05 3,42	34,67 3,35
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,97 498,71	-1,95 -100,02	2,19 340,49	-2,34 -148,99	-0,52 -12,31	6,18 57,10	14,07 75,32
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,38 0,11	-0,65 10,36	31,79 3,96	-2,63 6,91	12,75 11,67	62,07 32,16	87,26 31,14
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,78 0,51	-6,42 4,59	26,25 -1,58	-4,21 5,32	10,38 9,30	49,87 19,96	106,14 50,03
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	10,05 1,78	-16,95 -5,94	29,32 1,49	-15,87 -6,33	-6,40 -7,48	22,01 -7,90	57,60 1,49
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,35 2,08	-8,92 2,09	29,17 1,33	-8,39 1,15	5,22 4,14	33,39 3,48	68,54 12,42
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	13,85 4,34	-9,94 3,26	30,77 -0,89	-15,24 -1,65			
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	14,10 5,84	-9,01 2,00	31,13 3,30	-14,70 -5,17	11,76 10,68	63,00 33,09	99,63 43,51
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,13 -0,13	-4,68 6,33	31,96 4,13	-6,66 2,88	19,94 18,86		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,36 -3,90	-16,57 -5,56	19,15 -8,68	-17,09 -7,55	-4,41 -5,49	43,60 13,69	57,70 1,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,38 -1,89	-12,84 -1,83	22,84 -4,99	-11,57 -2,03	0,02 -1,06	50,60 20,69	
RBRD11 Var. IBOVESPA p.p.	-4,64 -12,90	-5,55 5,46	32,64 4,81	-5,30 4,23	0,97 -0,11	33,23 3,33	39,00 -17,11
FIP LSH - MULTISTRATÉGIA	-0,04	-0,31	-0,13	-0,27	-0,51	-73,58	



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-22,70	-15,96	-20,49	-17,04	-12,11	-679,53	
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT	0,20	-0,77	0,12	-1,69	2,48	9,48	20,95
% do CDI	104,70	-39,47	18,86	-107,58	58,88	87,59	112,19
MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	0,83	2,14	3,41	1,60	5,93	15,69	
% do CDI	427,64	109,59	530,05	102,22	140,70	144,93	
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	1,44	2,37	6,21	2,39	6,23	15,42	24,44
% do CDI	743,22	121,61	964,75	152,42	147,89	142,39	130,86
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	8,14	-11,05	27,43	-9,54	0,90	29,08	54,06
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-0,04	-0,41	-0,01	-0,18	-0,83	-2,06
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,31	56,90	17,45	44,19			
Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,41	52,99	15,71	41,03			
CAMPINAS CONSOLIDADO	3,17	-0,15	8,36	-0,43	5,92		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	2,45	-2,92	7,12	-2,63	-0,50		
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 + 6,00%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6,00%	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
<b>Renda Fixa</b>							
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
<b>Renda Variável</b>							
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
<b>Indicadores Econômicos</b>							
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
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
308	02/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	780.000,00	342.226,88864300	2,2791897010
309	02/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	25.000,00	10.968,81053300	2,2791897010
310	02/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.162,57264000	2,2791897010
311	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	935.000,00	410.138,61048400	2,2797170910
312	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.290.000,00	0,00	1.881.697,63131900	2,2798561940
313	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.579,36234700	2,2798561940
314	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	22.000,00	9.649,73144300	2,2798561940
315	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.579,36234700	2,2798561940
317	10/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.320.000,00	0,00	3.209.786,53319900	2,2805254880
318	10/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	130.000,00	57.004,40564400	2,2805254880
316	10/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.500,00	2.850,22028200	2,2805254880
324	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	445.000,00	0,00	195.093,19107200	2,2809612040
319	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	90.000,00	39.457,04988000	2,2809612040
320	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	95.000,00	41.649,10820600	2,2809612040
321	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.304,69992000	2,2809612040
322	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.000,00	43.841,16653300	2,2809612040
323	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.650.000,00	2.038.614,24378700	2,2809612040
330	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.471.941,95	0,00	1.959.646,25298400	2,2820149010
325	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.365.000,00	0,00	598.155,60336600	2,2820149010
326	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.697.193,26	0,00	743.725,75711700	2,2820149010
327	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	304.140,55	0,00	133.277,19721100	2,2820149010
328	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.800.000,00	0,00	6.923.705,88512600	2,2820149010
329	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.444.091,44	0,00	632.814,20264400	2,2820149010
331	21/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	164.000,00	71.862,27037100	2,2821433160
337	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	563.073,91	246.573,77452000	2,2835920450
338	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000,00	437,90658800	2,2835920450
332	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.590.000,00	696.271,47435600	2,2835920450
333	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	22.800.000,00	9.984.270,19831300	2,2835920450

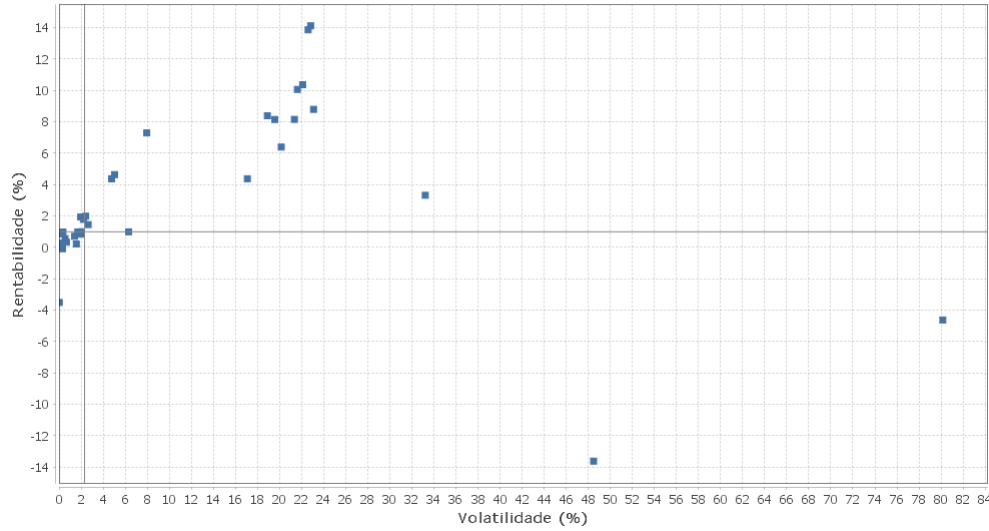
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
334	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	685.000,00	299.966,01253700	2,2835920450
335	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	400.000,00	175.162,63505800	2,2835920450
336	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.290.000,00	564.899,49806300	2,2835920450
340	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.067.536,64	0,00	467.408,72304600	2,2839467630
339	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.455.211,36	0,00	637.147,67067800	2,2839467630
348	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.713,73	0,00	2.501,59653800	2,2840333810
341	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	500.000,00	0,00	218.910,98622200	2,2840333810
342	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.355,63	0,00	1.906,99051700	2,2840333810
343	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	18.878,17	0,00	8.265,27762500	2,2840333810
344	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.923,96	0,00	13.101,36719000	2,2840333810
345	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.527,40	0,00	5.046,94900500	2,2840333810
346	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.576,61	0,00	690,27449900	2,2840333810
347	31/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	74.942,67	0,00	32.811,54759900	2,2840333810
<b>Total</b>						

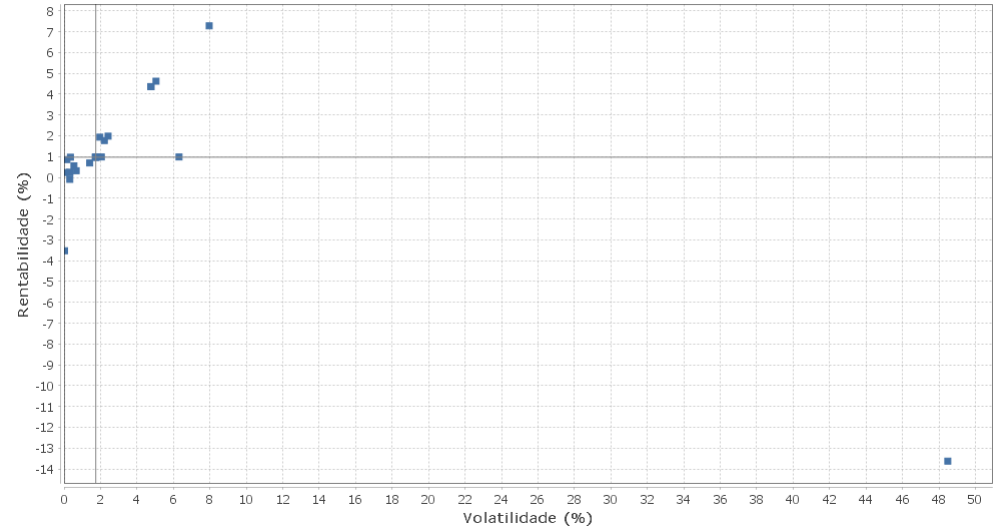
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

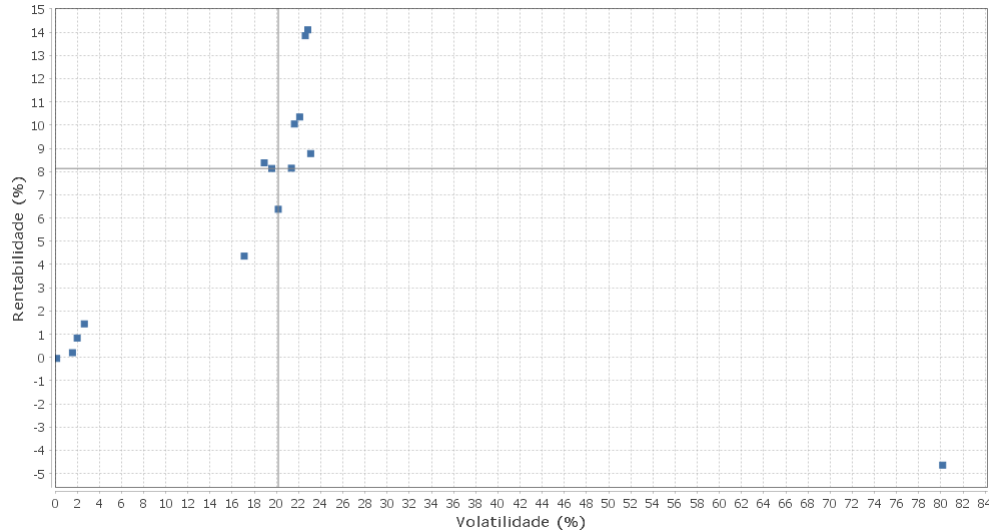
CAMPINAS CONSOLIDADO - No Mês



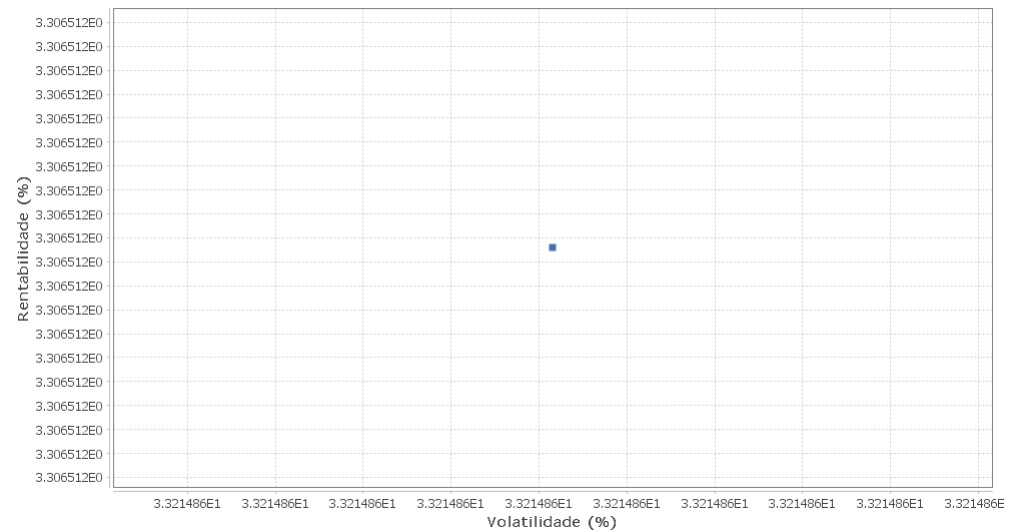
Renda Fixa - No Mês



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\$): 69.637.248,93

Value-At-Risk: 7,24%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,03	0,36	0,00	-134,96	-3,52	172.662,92	0,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,10	-0,00	0,78	0,24	175.421.049,99	18,23
FIP LSH - MULTISTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,15	0,01	0,00	-1,63	-0,04	3.944.075,70	0,41
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,16	0,10	-0,00	4,13	0,86	14.409.300,00	1,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,34	0,00	0,15	0,24	1.504.836,79	0,16
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,34	0,00	0,12	0,23	6.147.549,98	0,64
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	0,32	0,71	0,00	-0,92	-0,10	30.705,71	0,00
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,35	1,56	0,00	2,21	0,97	3.880.623,29	0,40
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,53	0,01	0,66	0,55	27.036.373,10	2,81
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,67	1,02	0,00	0,19	0,32	5.527.919,68	0,57
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,41	2,40	0,03	0,35	0,69	15.821.588,16	1,64
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT	Artigo 8º III	1,57	1,11	0,00	0,01	0,20	4.383.891,48	0,46
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	2,11	0,09	0,45	0,97	50.517.277,69	5,25
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	2,26	0,04	0,45	0,97	24.123.108,61	2,51
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	2,27	0,15	0,45	0,97	80.624.548,29	8,38
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,83	2,42	0,01	0,43	0,97	6.851.631,53	0,71
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	1,96	2,44	0,03	0,88	1,93	13.395.661,17	1,39
MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	Artigo 8º III	2,00	2,19	0,01	0,32	0,83	6.344.201,35	0,66
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,04	1,97	0,00	0,39	0,98	2.286.247,64	0,24
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	3,09	0,28	0,71	1,77	98.445.326,73	10,23
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º III, Alínea a	2,42	2,65	0,02	0,74	1,98	10.213.837,77	1,06
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	Artigo 8º III	2,65	3,66	0,02	0,47	1,44	4.620.630,60	0,48
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,76	5,98	0,34	0,87	4,36	60.799.939,64	6,32
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	5,91	0,35	0,87	4,35	64.740.137,51	6,73
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,04	6,94	0,20	0,88	4,62	31.119.831,95	3,23
FIDC SANASA	Artigo 7º VII, Alínea a	6,31	0,26	0,00	0,12	0,98	4.576.060,84	0,48
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,96	9,30	0,35	0,89	7,28	40.892.911,23	4,25
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,09	28,04	0,82	0,24	4,36	29.154.360,88	3,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,89	29,94	0,70	0,43	8,38	23.486.932,86	2,44
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,57	29,67	0,28	0,41	8,13	9.632.635,91	1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,16	27,64	0,27	0,31	6,38	9.455.264,91	0,98
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,34	26,19	0,89	0,37	8,14	33.404.933,70	3,47
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	21,62	25,69	0,50	0,46	10,05	19.240.347,88	2,00
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,09	27,09	0,80	0,46	10,35	28.844.610,52	3,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,60	27,14	0,23	0,60	13,85	8.803.104,63	0,91
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,82	27,10	0,30	0,61	14,10	11.176.410,07	1,16
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,08	32,37	0,49	0,37	8,78	14.929.853,74	1,55
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	33,21	18,33	0,02	0,09	3,31	14.056.859,83	1,46
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	Artigo 7º VII, Alínea a	48,49	1,52	0,00	-0,29	-13,63	7.378,83	0,00
RBRD11	Artigo 8º IV, Alínea b	80,16	5,66	0,00	-0,06	-4,64	2.251.731,35	0,23