



**LDB**  
EMPRESAS

**CATANDUVA**  
SETEMBRO 2019



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 28.01.2020.

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

80,36%

## Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	14,16	-6,67	16,22	7.252.455,37	2,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,410000%)	4,29	4,09	8,62	3.174.832,52	1,05
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>10,10</b>	<b>-3,64</b>	<b>16,42</b>	<b>10.427.287,89</b>	<b>3,46</b>

## 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 PREVID RF IRF-M1	0,30	0,62	5,12	9.674.763,75	3,21	7.803.027.907,11	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	5,20	2,85	19,37	18.007.400,78	5,97	11.475.861.578,54	0,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,28	0,63	5,15	12.069.687,54	4,00	11.445.572.813,24	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,29	1,44	10,29	1.500.187,60	0,50	1.440.896.007,65	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	2,14	1,72	10,08	49.481.834,66	16,41	10.040.403.127,50	0,49
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,54	1,41	3,83	14.174.804,46	4,70	7.885.241.073,51	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,55	1,42	8,58	49.445.152,49	16,40	8.745.766.983,49	0,57
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,33	2,15	12,75	21.143.749,89	7,01	506.807.313,87	4,17
BB	BB	BB PREV RF VII	1,52	1,08	7,85	252.469,23	0,08	674.444.070,06	0,04
BB	BB	BB PREV RF TP IX	0,01	0,44	4,46	1.382.383,23	0,46	94.602.139,76	1,46
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	4,97	2,19	11,27	1.481.458,00	0,49	209.126.669,61	0,71
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,66	1,67	10,98	1.306.414,35	0,43	544.119.627,20	0,24
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,88	0,70	6,11	1.225.602,14	0,41	996.090.159,62	0,12
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,93</b>	<b>1,63</b>	<b>10,01</b>	<b>181.145.908,12</b>	<b>60,08</b>		

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,05	0,78	6,57	8.628.103,97	2,86	2.130.429.835,02	0,40
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,45	3,78	30.180,64	0,01	12.321.555.394,07	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,18	2,84	19,23	23.393.543,42	7,76	1.569.202.594,81	1,49
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,02	0,37	3,82	879.589,16	0,29	1.489.281.051,07	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,39	4,01	24.086,87	0,01	425.100.244,00	0,01
BRADERSCO	BRADERSCO	BRADERSCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2	2,26	1,53	5,10	7.791.402,15	2,58	600.693.950,60	1,30
BRADERSCO	BRADERSCO	BRADERSCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,40	1,48	8,10	3.243.149,12	1,08	833.675.084,59	0,39
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,63</b>	<b>1,99</b>	<b>12,17</b>	<b>43.990.055,33</b>	<b>14,59</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
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	101,45	-0,15	-8,65	465.110,31	0,15	86.250.471,13	0,54
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	322,29	-2,17	6.019,77	34.731,16	0,01	6.656.859,10	0,52
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>107,25</b>	<b>-0,30</b>	<b>3,00</b>	<b>499.841,47</b>	<b>0,17</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 CRED PRIV III	1,84	1,66	9,54	4.170.848,15	1,38	571.129.018,97	0,73
ICATU VANGUARDA	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	1,98	1,61	6,04	1.060.368,88	0,35	459.018.350,63	0,23
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,08	0,43	1,53	1.015.344,12	0,34	153.799.252,24	0,66
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>1,59</b>	<b>1,45</b>	<b>9,44</b>	<b>6.246.561,15</b>	<b>2,07</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,23</b>	<b>1,45</b>	<b>10,29</b>	<b>242.309.653,96</b>	<b>80,36</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,85%

## 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
FRANKLIN TEMPLETON	BNY MELLON	FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI DE AÇÕES	19,07	2,76	20,51	1.282.836,38	0,43	336.271.079,27	0,38
ICATU VANGUARDA	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	16,42	2,64	29,63	4.667.046,24	1,55	1.581.305.323,77	0,30
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,91	0,76	25,14	2.578.691,84	0,86	1.262.371.454,02	0,20
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,83	1,25	26,61	6.851.185,17	2,27	1.490.872.974,30	0,46
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	20,35	2,58	12,89	3.284.394,84	1,09	268.305.903,42	1,22
EQUITAS	BNY MELLON	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA	20,92	0,66	38,75	1.574.682,63	0,52	214.175.081,10	0,74
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,46	0,79	26,40	1.335.492,24	0,44	387.988.727,91	0,34
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,95	3,42	18,71	1.766.673,34	0,59	3.465.972.947,23	0,05
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,91	2,15	0,02	1.000.175,68	0,33	483.011.427,88	0,21
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>16,86</b>	<b>1,85</b>	<b>24,74</b>	<b>24.341.178,36</b>	<b>8,07</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,71	-0,04	3,13	2.546.163,42	0,84	241.433.480,84	1,05
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15,72	2,21	21,57	20.056.550,50	6,65	737.738.497,44	2,72
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>12,25</b>	<b>1,95</b>	<b>19,17</b>	<b>22.602.713,92</b>	<b>7,50</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	1,87	-0,09	-0,80	3.162.576,06	1,05	572.786.978,20	0,55
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME CA	101,53	-0,46	-134,83	2.499.120,67	0,83	106.295.933,02	2,35
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>27,01</b>	<b>-0,25</b>	<b>-10,86</b>	<b>5.661.696,73</b>	<b>1,88</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	6,89	1,30	4,15	1.204.383,12	0,40	70.593.824,53	1,71
		<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>	<b>6,89</b>	<b>1,30</b>	<b>4,15</b>	<b>1.204.383,12</b>	<b>0,40</b>		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	10,64	1,65	18,20	53.809.972,13	17,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,79%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,45	2,66	27,41	3.281.658,90	1,09	589.391.271,12	0,56
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	16,06	0,59	28,53	2.123.949,20	0,70	298.010.391,68	0,71
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>14,48</b>	<b>1,84</b>	<b>27,85</b>	<b>5.405.608,10</b>	<b>1,79</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>14,34</b>	<b>1,84</b>	<b>30,22</b>	<b>5.405.608,10</b>	<b>1,79</b>		
<b>Total</b>						<b>301.525.234,19</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 a	Títulos do Tesouro Nacional	10.427.287,89	3,46	0,00	2,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	181.145.908,12	60,08	15,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	43.990.055,33	14,59	10,00	20,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	499.841,47	0,17	0,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	6.246.561,15	2,07	0,00	5,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>242.309.653,96</b>	<b>80,36</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	24.341.178,36	8,07	2,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	22.602.713,92	7,50	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.661.696,73	1,88	0,00	5,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.204.383,12	0,40	0,00	5,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>53.809.972,13</b>	<b>17,85</b>				
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.405.608,10	1,79	0,00	0,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>5.405.608,10</b>	<b>1,79</b>				



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Rentabilidades por Artigo**

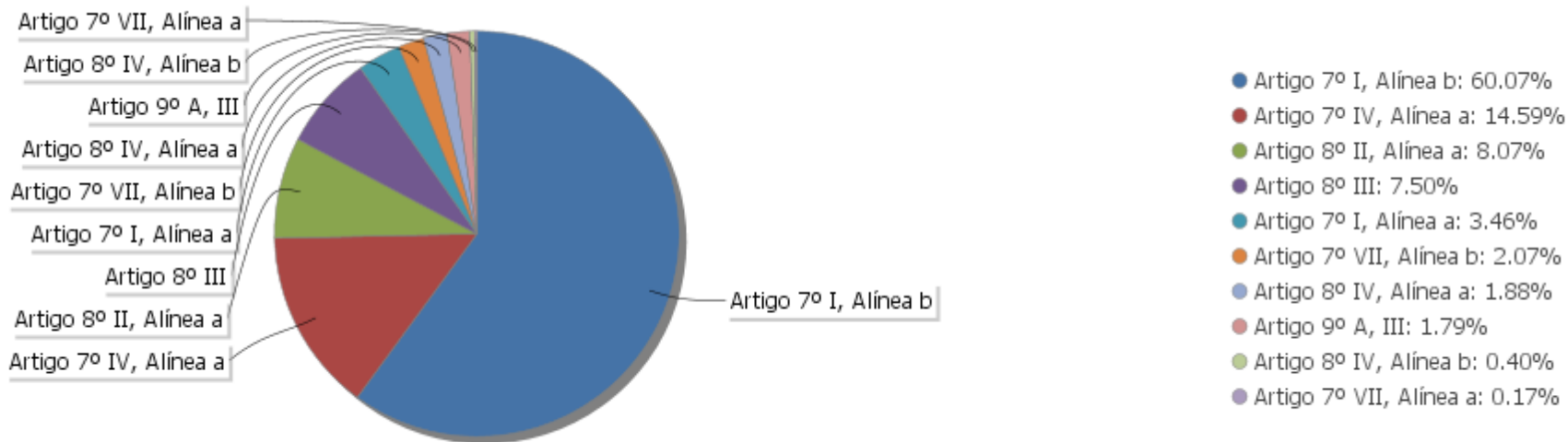
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-3,64 -784,92	16,42 352,08	-2,84 -184,00	7,25 233,78		-393.902,88	1.284.446,29
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,63 350,67	10,01 214,60	2,62 170,27	6,99 225,43		2.898.756,17	16.060.477,74
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,99 429,63	12,17 260,93	2,97 192,50	8,69 280,16		885.088,63	5.428.861,88
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,30 -63,64	3,00 64,44	-6,03 -391,44	-0,71 -23,01		-1.479,68	16.041,70
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,45 312,23	9,44 202,55	2,44 158,30	6,36 205,00		89.159,22	438.926,90
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,85 -1,72	24,74 5,56	7,85 4,11	18,32 8,54		441.455,00	3.947.657,78
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,95 -1,62	19,17 -0,02	2,07 -1,67	6,44 -3,34		432.189,76	3.635.227,90
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,25 -3,82	-10,86 -30,04	-0,99 -4,73	-9,22 -19,00		-14.437,18	-174.937,49
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,30 -2,27	4,15 -15,03	-3,79 -7,53	0,93 -8,85		15.478,51	48.698,80
Artigo 9º A, III % do CDI	1,84 395,74	27,85 597,21	9,67 627,72	12,81 412,95		97.420,56	1.177.398,12
						4.449.728,11	31.862.799,62

**Análise de Liquidez**

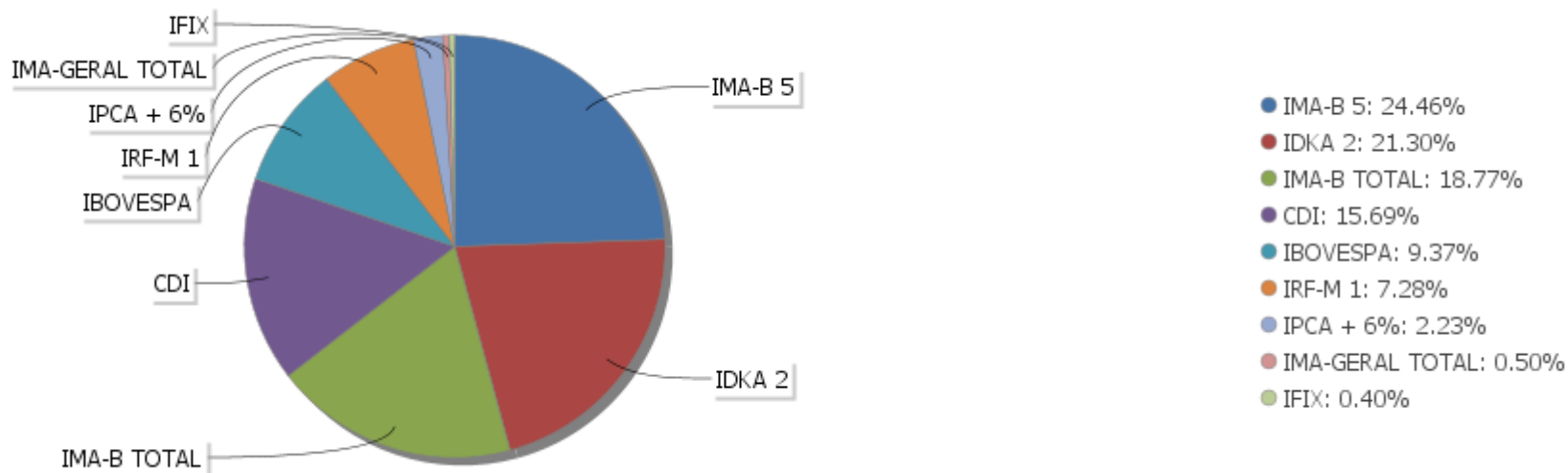
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	266.334.299,94	88,33	266.334.299,94	88,33
de 31 a 364 dias	10.651.645,62	3,53	276.985.945,56	91,86
acima de 365 dias	24.539.288,63	8,14	301.525.234,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

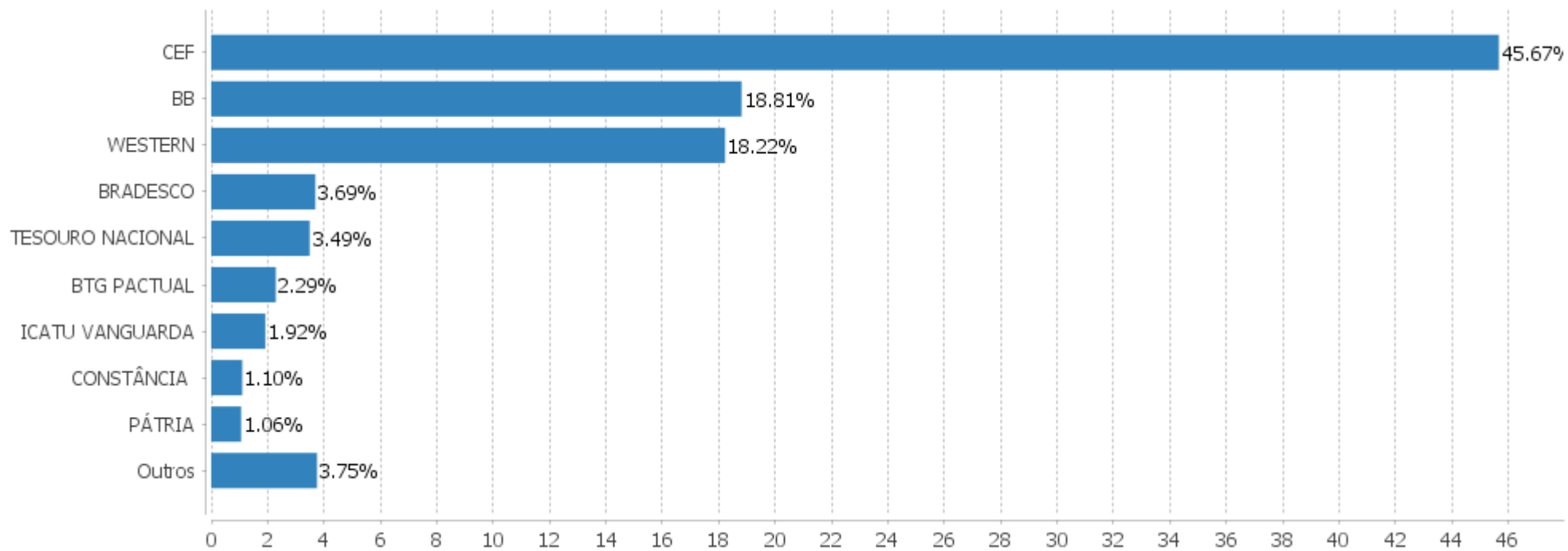


Alocação Por Estratégia



## 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
2019	2,47	0,65	0,74	1,42	0,99	2,43	1,19	0,12	1,49				12,07
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45				7,07
p.p. indexador	1,64	-0,24	-0,46	0,36	0,35	1,98	0,46	-0,50	1,04				5,00
2018	2,11	0,26	0,82	0,28	-1,28	0,05	1,67	0,09	0,60	2,35	0,66	0,41	8,25
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,30	-0,48	0,24	-0,43	-2,17	-1,70	0,83	-0,35	-0,33	1,39	0,40	-0,20	-1,67

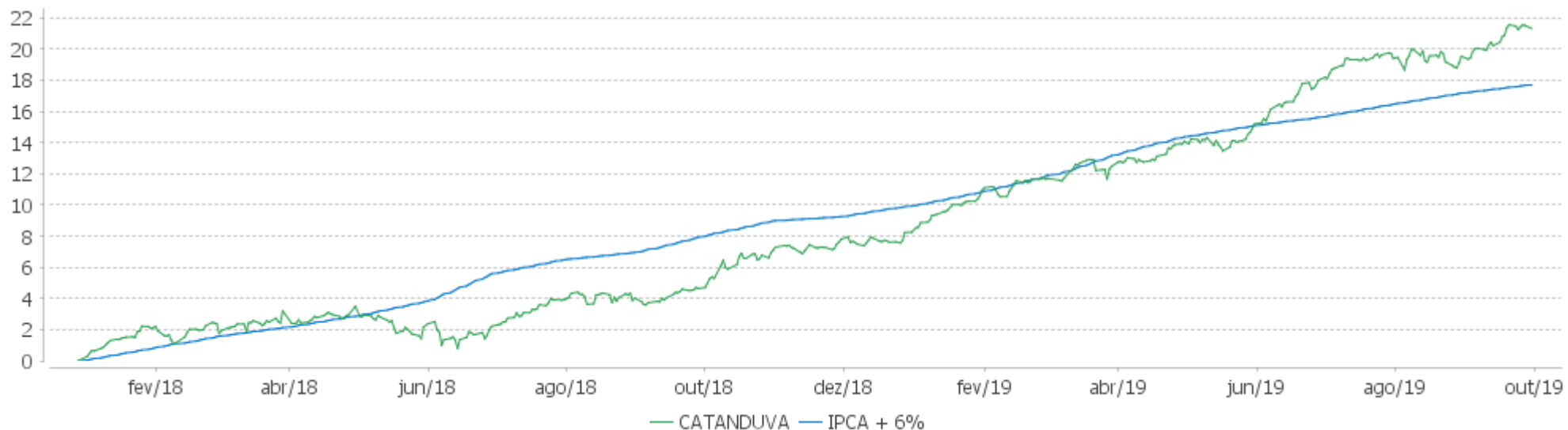
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

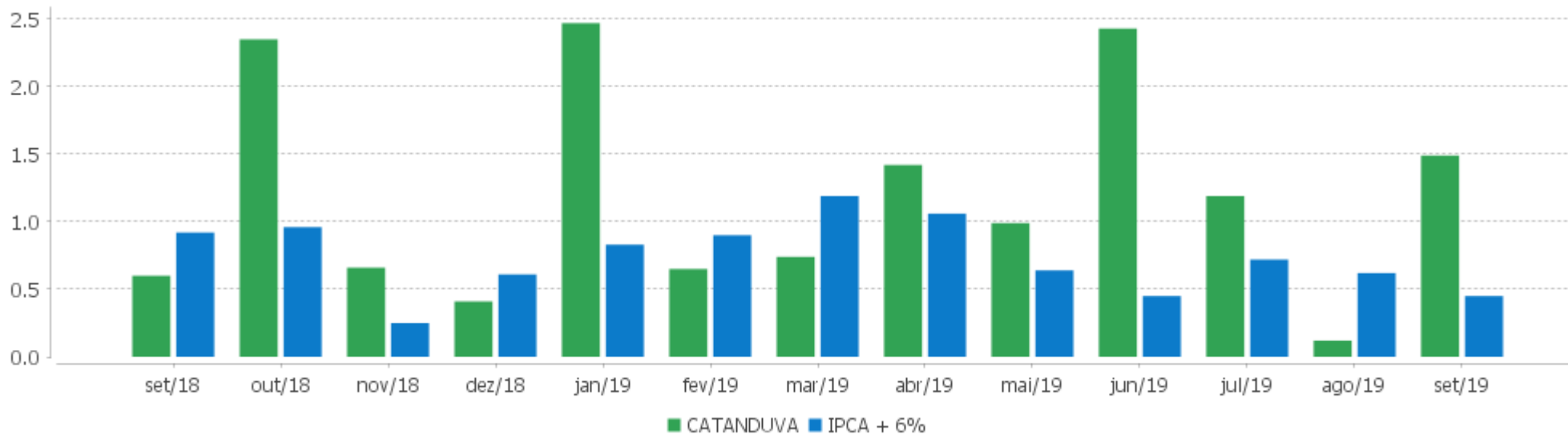
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	52,38	03 meses	2,81	1,80	1,01	3,50
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	47,62	06 meses	7,87	4,01	3,86	3,24
			12 meses	15,94	9,04	6,90	3,20
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,47	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,28	2018-05	Desde 29/12/2017	21,31	17,69	3,62	3,43

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
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,84 -0,02	19,23 -0,31	3,68 -0,09	13,06 -0,21	30,92 -0,45	34,05 -0,68	55,23 -0,73
BRADESCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2 % do CDI	1,53 329,83	9,69 207,72	2,87 186,28	7,44 239,72	16,19 258,06	24,51 183,73	46,63 176,57
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,37 80,30	3,82 81,83	1,25 81,18	2,54 81,77	5,13 81,83	10,94 81,97	22,63 85,68
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI % do CDI	0,78 168,34	6,57 140,83	1,74 113,16	4,51 145,43	10,09 160,81	17,04 127,73	31,66 119,88
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,45 97,73	4,55 97,61	1,51 97,71	3,03 97,65	6,12 97,59	13,03 97,64	25,98 98,40
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,39 85,12	4,01 85,92	1,32 85,66	2,67 85,92	5,39 85,91	11,49 86,09	23,34 88,38
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	1,48 319,36	10,44 223,83	2,53 163,99	7,33 236,37	16,59 264,57		
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	1,61 -0,13	10,11 -0,16	2,61 -0,17	6,97 -0,20	15,19 -0,21	23,64 0,70	42,75 3,28
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	1,66 1,21	9,54 2,47	2,62 0,82	6,45 2,45	14,32 5,28	23,53 2,79	43,19 12,03
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,43	4,79	1,51	3,12	6,50	13,98	27,78
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,15 -32,90	-8,65 -185,48	-6,51 -422,17	-8,22 -264,90	-9,30 -148,32	-11,30 -84,68	-18,49 -70,02
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-2,17 -467,13	6.019,77 129.104,87	0,32 20,49	484,70 15.621,52	2.955,19 47.114,29	163.326,70 1.224.148,48	150.077,01 568.336,56
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,67 -9,53	16,22 -3,33	-5,97 -9,74	7,13 -6,13	31,60 0,23	29,37 -5,36	53,01 -2,95
NTN-B 150545 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,09 1,23	9,89 -9,65	5,17 1,41	7,53 -5,73	9,12 -22,25		
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	2,15 0,41	12,75 2,48	3,05 0,27	9,09 1,93	20,45 5,05	27,43 4,50	46,62 7,15
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,85 -0,01	19,37 -0,18	3,72 -0,05	13,12 -0,15	31,16 -0,21	34,16 -0,56	55,13 -0,83
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	10,08 -0,19	2,72 -0,06	7,04 -0,13	15,21 -0,19	22,44 -0,49	38,69 -0,78

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

BB PREV RF TP IX Var. IMA-B 5 p.p.	0,44 -1,30	4,46 -5,81	1,48 -1,31	2,97 -4,20	5,99 -9,41	14,00 -8,94	26,42 -13,05
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,62 -0,02	5,12 -0,19	1,85 -0,07	3,60 -0,12	7,22 -0,22	14,20 -0,49	28,34 -0,87
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,44 -0,02	10,29 -0,43	2,52 -0,09	7,25 -0,27	16,39 -0,39	22,07 -1,00	40,17 -1,12
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,19 -0,67	11,27 -8,28	3,20 -0,57	10,11 -3,16	20,38 -10,99	17,50 -17,22	29,02 -26,94
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 -2,16	6,11 -13,44	1,68 -2,09	3,83 -9,44	9,04 -22,33	17,61 -17,11	26,95 -29,01
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,67 -1,19	10,98 -8,56	2,70 -1,07	7,61 -5,65	17,55 -13,82	23,59 -11,13	42,29 -13,67
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 -1,78	7,85 -11,69	2,09 -1,67	5,18 -8,08	12,01 -19,36	20,16 -14,56	35,69 -20,27
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,41 -0,18	8,36 -0,77	2,46 -0,25	5,73 -0,76	12,10 -0,74	20,62 -1,83	35,98 -3,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,42 -0,17	8,58 -0,55	2,46 -0,26	5,93 -0,56	12,28 -0,57	20,88 -1,57	36,32 -2,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,63 -0,02	5,15 -0,15	1,86 -0,06	3,63 -0,09	7,28 -0,17	14,32 -0,38	28,55 -0,66
KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME CA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,46 -0,91	13,74 6,67	-1,86 -3,66	26,71 22,70	87,12 78,07		
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,09 -19,49	-0,80 -17,25	-0,28 -18,42	-0,55 -17,65	0,81 12,99	2,71 20,30	3,83 14,51
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,04 -7,65	3,13 67,12	0,83 53,90	1,76 56,60	5,51 87,90	13,17 98,73	27,41 103,79
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	2,21 475,90	21,57 462,51	2,23 144,55	7,06 227,64	6,23 99,38	28,06 210,31	64,20 243,11
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,25 -2,32	26,61 7,43	7,95 4,21	21,60 11,82	52,23 20,22	53,35 12,37	89,31 9,85
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,66 -2,91	38,75 19,57	14,31 10,57	28,38 18,60	70,60 38,58	61,73 20,74	128,02 48,56
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	2,76 -0,81	20,51 1,33	7,03 3,29	12,55 2,77	40,79 8,77	41,14 0,15	88,47 9,01
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,76 -2,81	25,14 5,96	12,43 8,69	23,11 13,33	58,04 26,02	59,79 18,81	128,23 48,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3,42	28,77	8,98	20,27	46,74	60,66	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	2,64	29,63	6,56	18,69	58,03	61,56	91,07



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	10,45	2,82	8,91	26,01	20,57	11,61
OCCAM FIC FIA	0,79	26,40	11,64	17,76	41,39	59,18	99,09
Var. IBOVESPA p.p.	-2,78	7,22	7,90	7,98	9,38	18,19	19,63
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	2,58	18,88	2,95	8,79	31,43	44,43	79,98
Var. IBOVESPA p.p.	-0,99	-0,30	-0,79	-0,99	-0,59	3,44	0,52
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2,15	24,76	2,35	10,50	55,71		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,42	5,58	-1,39	0,72	23,69		
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	1,30	4,15	-3,79	0,93	6,81		
Var. IFIX p.p.	0,26	-10,00	-6,01	-7,18	-18,93		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,66	27,41	10,26	12,74	5,65	58,09	78,88
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	8,22	6,52	2,96	-26,37	17,10	-0,58
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	0,59	28,53	8,78	12,93	6,12	56,62	77,92
Var. IBOVESPA p.p.	-2,98	9,35	5,04	3,15	-25,90	15,63	-1,54
CDI	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
INPC + 6%	0,44	7,21	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35
IPCA + 6%	0,45	7,07	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16

**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	0,64	5,31	1,92	3,72	7,44	14,70	29,21
IRF-M 1+	1,87	11,89	3,27	9,07	20,81	27,25	51,71
IRF-M TOTAL	1,44	9,99	2,81	7,53	16,83	23,54	45,09
IMA-B 5	1,74	10,27	2,78	7,17	15,40	22,93	39,47
IMA-B 5+	3,73	26,55	4,48	17,54	44,85	43,66	68,51
IMA-B TOTAL	2,86	19,55	3,77	13,27	31,37	34,72	55,96
IMA-C TOTAL	1,74	17,25	3,44	11,52	23,71	39,55	50,80
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,46	10,53	2,59	7,40	16,57	22,60	41,10
IMA-GERAL TOTAL	1,46	10,72	2,61	7,52	16,78	23,07	41,30
IDKA 2	1,60	9,13	2,72	6,49	12,85	22,46	39,19
IDKA 20	4,78	39,62	5,22	24,54	72,09	60,71	94,10
CDI	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
IBRX 100	3,21	20,50	4,25	10,92	34,84	42,73	81,88
IBRX 50	3,69	17,61	3,06	8,52	29,03	38,44	75,75
SMALL CAP	2,08	30,58	9,49	21,44	57,29	45,27	105,52
IFIX	1,04	14,15	2,21	8,11	25,74	20,86	47,81
Índice Consumo - ICON	2,64	42,35	17,30	33,49	54,64	29,25	55,37
Índice Dividendos - IDIV	1,89	27,02	7,04	17,36	52,83	44,68	105,47
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	-0,04	2,49	0,26	0,97	2,89	7,55	10,28
INPC	-0,05	2,63	0,17	0,93	2,92	7,01	8,76
IGPM	-0,01	4,10	-0,28	1,90	3,38	13,77	12,11
SELIC	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,35	26,43
<b>Meta Atuarial</b>							
IPCA + 4%	0,29	5,55	1,30	3,00	6,99	16,25	23,93

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	0,37	6,31	1,55	3,51	8,02	18,48	27,51
IPCA + 5,5%	0,41	6,69	1,68	3,76	8,53	19,60	29,33
IPCA + 5,89%	0,44	6,99	1,77	3,95	8,93	20,48	30,76
IPCA + 6%	0,45	7,07	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16
INPC + 4%	0,28	5,69	1,20	2,96	7,02	15,67	22,22
INPC + 6%	0,44	7,21	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	194.209,03	0,00	106.654,87220400	1,8209110000
03/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.466,56	714,25386200	2,0532755610
03/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.931,89	3.257,01782700	1,8212640000
04/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	650,54	357,12243900	1,8216160000
05/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	60.000,00	29.210,69113800	2,0540424640
05/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.500,00	823,28505200	1,8219690000
05/09/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	15.000,00	319,87067000	46,8939600000
05/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	496,56	0,00	241,74767900	2,0540424640
06/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.184,68	576,65219900	2,0544099230
06/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	45.739,83	0,00	22.264,21781100	2,0544099230
06/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	22.860,62	12.544,77604700	1,8223220000
09/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	71,32	34,70924700	2,0547838650
09/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	51,68	28,35339400	1,8226750000
10/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	3.634,83	1.768,64901900	2,0551448940
10/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	361,51	0,00	175,90487200	2,0551448940
10/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	993,29	544,85681500	1,8230280000
11/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	105.745,10	57.993,93453700	1,8233820000
12/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	7.116,11	3.461,29725100	2,0559083730
12/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	184.957,92	0,00	89.964,08713000	2,0559083730
12/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	217,21	119,10171200	1,8237350000
13/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	2.803,74	1.363,49290700	2,0562923250
16/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.346.944,00	0,00	654.914,86260600	2,0566703810
16/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	103,54	56,75112700	1,8244430000
17/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.773,88	862,35708900	2,0570132980
17/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	395.852,31	192.440,32616800	2,0570132980
18/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.995,75	4.380,87250800	1,8251500000
19/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	255.767,35	124.292,85963000	2,0577799140
19/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	32.112,48	0,00	17.591,03107400	1,8255030000

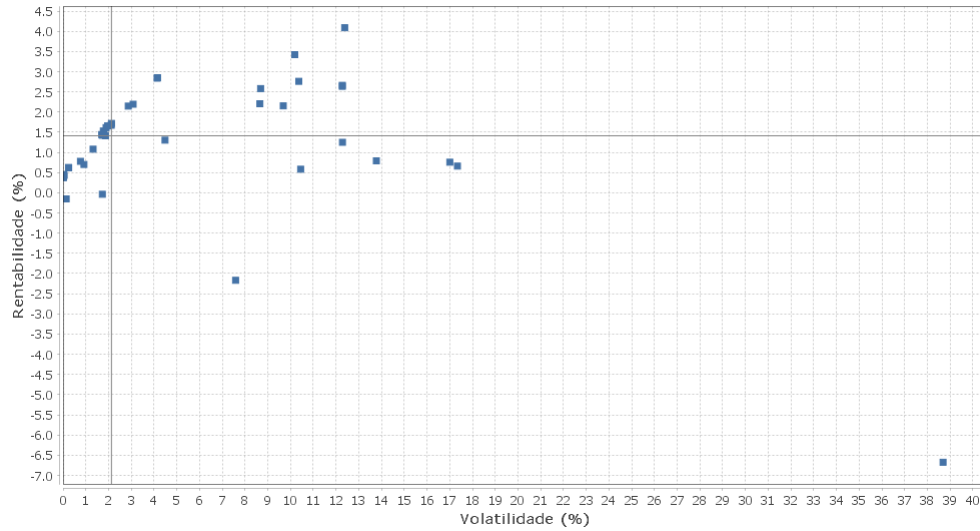
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

20/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.797,36	0,00	1.532,10908100	1,8258230000
23/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	19.726,90	9.583,29347000	2,0584676930
24/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	9.900,00	4.808,59208800	2,0588146840
24/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	2.500.000,00	1.214.290,93129600	2,0588146840
24/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	76.161,18	0,00	41.698,72589800	1,8264630000
25/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	11.791,59	5.726,40640200	2,0591605230
25/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	67.235,68	36.805,52757100	1,8267820000
26/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.114,51	0,00	2.251,93229400	1,8271020000
26/09/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	150.000,00	0,00	3.188,39289000	47,0456450000
27/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	871,17	476,72060800	1,8274230000
30/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	5.432,22	0,00	2.636,79689100	2,0601586790
30/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	658.430,99	0,00	319.602,07566100	2,0601586790
30/09/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	100.000,00	54.712,23068400	1,8277450000
30/09/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	125.000,00	2.655,91553000	47,0647510000

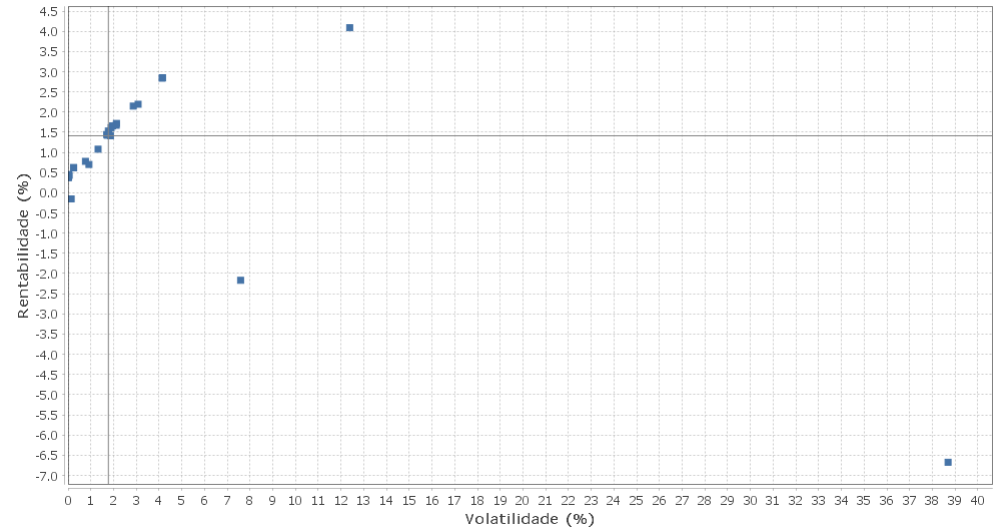
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

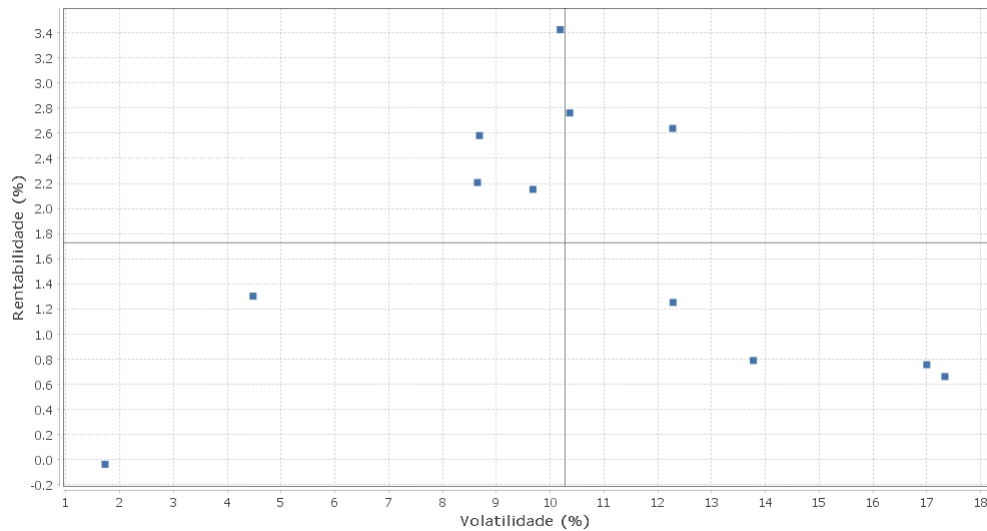
CATANDUVA - No Mês



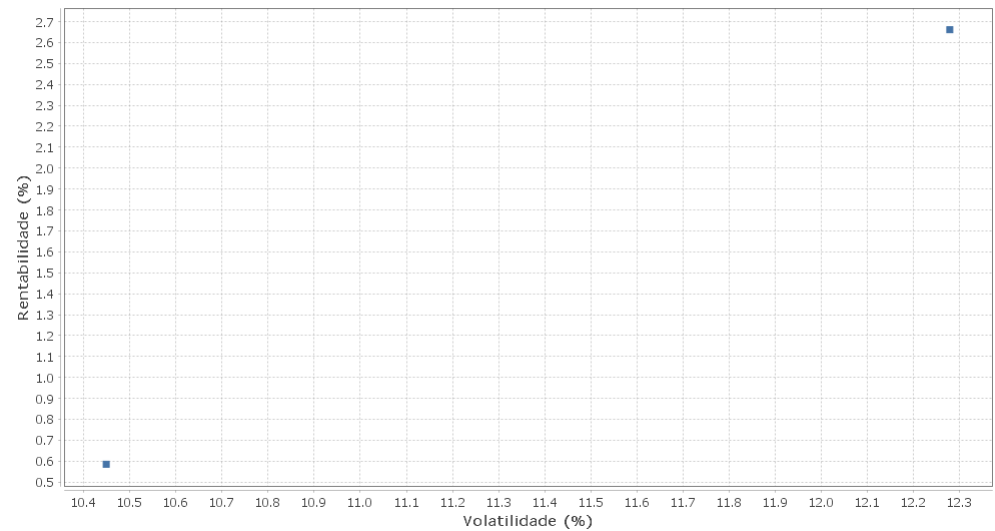
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,45	30.180,64	0,01
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,39	24.086,87	0,01
BB PREV RF TP IX	Artigo 7º I, Alínea b	0,01	0,02	0,44	1.382.383,23	0,46
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,37	879.589,16	0,29
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,05	0,03	0,43	1.015.344,12	0,34
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,14	0,01	-0,15	465.110,31	0,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,06	0,63	12.069.687,54	4,00
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,25	0,06	0,62	9.674.763,75	3,21
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,76	0,12	0,78	8.628.103,97	2,86
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,92	0,13	0,70	1.225.602,14	0,41
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,32	0,19	1,08	252.469,23	0,08
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,70	0,24	1,44	1.500.187,60	0,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	0,25	1,42	49.445.152,49	16,40
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,73	0,18	-0,04	2.546.163,42	0,84
BRADESCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	1,77	0,26	1,53	7.791.402,15	2,58
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,80	0,26	1,48	3.243.149,12	1,08
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,86	0,26	1,41	14.174.804,46	4,70
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	1,89	0,27	1,61	1.060.368,88	0,35
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,96	0,28	1,66	4.170.848,15	1,38
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,12	0,30	1,67	1.306.414,35	0,43
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	0,30	1,72	49.481.834,66	16,41
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	2,87	0,40	2,15	21.143.749,89	7,01
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	3,08	0,42	2,19	1.481.458,00	0,49
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,14	0,56	2,84	23.393.543,42	7,76
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,15	0,56	2,85	18.007.400,78	5,97
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Artigo 8º IV, Alínea b	4,48	0,53	1,30	1.204.383,12	0,40
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	7,59	0,68	-2,17	34.731,16	0,01
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	8,65	1,00	2,21	20.056.550,50	6,65
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,69	1,02	2,58	3.284.394,84	1,09



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,68	1,10	2,15	1.000.175,68	0,33
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	10,19	1,22	3,42	1.766.673,34	0,59
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	10,36	1,20	2,76	1.282.836,38	0,43
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	Artigo 9º A, III	10,45	1,11	0,59	2.123.949,20	0,70
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,28	1,40	2,64	4.667.046,24	1,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	12,28	1,40	2,66	3.281.658,90	1,09
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,28	1,33	1,25	6.851.185,17	2,27
NTN-B 150545 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	12,39	1,47	4,09	3.174.832,52	1,05
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,78	1,46	0,79	1.335.492,24	0,44
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,00	1,80	0,76	2.578.691,84	0,86
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,34	1,83	0,66	1.574.682,63	0,52
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	38,68	3,68	-6,67	7.252.455,37	2,41