



LDB
EMPRESAS

CATANDUVA
NOVEMBRO 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 80,01%

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	27,81	4,89	22,55	7.492.425,22	2,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,410000%)	10,61	5,00	14,45	3.267.395,57	1,09
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		18,46	4,91	22,72	10.759.820,79	3,58

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,72	-2,54	20,20	74.300.387,71	24,72	6.860.700.810,84	1,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,01	-0,75	11,32	1.514.169,60	0,50	1.438.721.482,21	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,93	-0,34	11,51	50.123.544,64	16,68	9.996.525.968,83	0,50
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,12	-1,01	14,34	21.443.169,31	7,13	487.496.231,60	4,40
BB	BB	BB PREV RF VII	1,25	0,43	9,46	256.218,70	0,09	684.460.380,72	0,04
BB	BB	BB PREV RF TP IX	0,03	0,36	5,31	1.393.660,86	0,46	78.059.141,34	1,79
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	4,46	-0,99	12,80	1.501.857,00	0,50	212.006.249,68	0,71
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,22	-0,29	12,52	1.324.455,60	0,44	551.633.779,32	0,24
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,82	0,87	7,82	1.245.361,75	0,41	1.012.149.920,47	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,10	-1,53	10,46	153.102.825,17	50,94		

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
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,03	-0,19	7,47	8.701.027,28	2,89	2.351.096.223,36	0,37
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,03	0,37	4,64	55.535,47	0,02	14.338.426.800,55	0,00
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	4,82	-2,56	-2,25	7.747.547,91	2,58	1.864.594.011,71	0,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,70	-2,49	20,15	45.498.752,34	15,14	1.605.362.434,48	2,83
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,03	0,29	4,52	4.182.259,90	1,39	1.223.624.372,04	0,34
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,30	4,75	360.616,58	0,12	507.356.679,02	0,07
BRADERSCO	BRADERSCO	BRADERSCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2	2,04	-0,26	6,53	0,00	0,00	649.783.472,97	0,00
BRADERSCO	BRADERSCO	BRADERSCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,16	-0,94	9,14	3.274.051,49	1,09	1.015.325.062,17	0,32
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,83	-2,09	12,63	69.819.790,97	23,23		

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	101,25	-0,20	-8,98	463.414,31	0,15	86.250.471,13	0,54
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	295,09	61,70	7.384,25	27.377,45	0,01	6.656.859,10	0,41
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			96,92	1,98	4,83	490.791,76	0,16		

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	1,65	-0,19	10,98	4.225.771,86	1,41	578.649.918,09	0,73
ICATU VANGUARDA	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	1,87	-0,85	6,70	1.067.027,55	0,35	539.480.987,52	0,20
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,16	0,09	1,82	1.018.186,86	0,34	164.390.136,65	0,62
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			1,57	-0,26	10,57	6.310.986,27	2,10		
Renda Fixa			2,53	-1,37	10,95	240.484.214,96	80,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,06%

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	16,98	1,31	25,27	1.333.466,17	0,44	374.935.136,41	0,36
ICATU VANGUARDA	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,88	0,46	32,65	4.775.717,86	1,59	2.037.041.662,03	0,23
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,16	4,14	35,05	2.782.952,28	0,93	1.349.430.352,56	0,21
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,08	0,24	29,89	7.028.710,34	2,34	1.600.410.389,56	0,44
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	17,63	2,32	18,14	3.436.986,03	1,14	293.583.284,45	1,17
EQUITAS	BNY MELLON	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA	18,78	0,36	45,43	1.650.506,83	0,55	251.826.207,19	0,66
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,59	-1,16	26,12	1.332.457,76	0,44	531.487.836,61	0,25
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	16,83	1,90	23,84	1.843.147,17	0,61	3.818.759.953,24	0,05
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	17,62	2,88	4,20	1.041.994,56	0,35	575.019.407,44	0,18
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,40	1,20	29,27	25.225.939,00	8,39		

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	1,67	-0,36	3,26	0,00	0,00	218.157.616,17	0,00
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	14,29	3,84	28,92	21.270.003,95	7,08	758.586.898,64	2,80
Sub-total Artigo 8º III			11,77	3,35	25,55	21.270.003,95	7,08		

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	0,22	-0,07	-0,97	3.157.360,30	1,05	572.786.978,20	0,55
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME CA	65,24	15,13	-138,81	3.664.163,73	1,22	106.295.933,02	3,45
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			25,48	7,56	-5,74	6.821.524,03	2,27		

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	21,54	14,48	-15,13	981.448,71	0,33	70.593.824,53	1,39
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	21,54	14,48	20,56	981.448,71	0,33		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	10,38	3,19	24,08	54.298.915,69	18,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,93%

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	16,38	8,92	36,87	3.525.374,75	1,17	642.628.500,90	0,55
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	14,73	8,68	37,73	2.275.952,01	0,76	364.391.265,00	0,62
Sub-total Artigo 9º A, III			14,42	8,82	37,21	5.801.326,76	1,93		
Investimentos no Exterior			14,30	8,82	39,75	5.801.326,76	1,93		
Total						300.584.457,41	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	10.759.820,79	3,58	0,00	2,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	153.102.825,17	50,94	15,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	69.819.790,97	23,23	10,00	20,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	490.791,76	0,16	0,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	6.310.986,27	2,10	0,00	5,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	240.484.214,96	80,01				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.225.939,00	8,39	2,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.270.003,95	7,08	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	6.821.524,03	2,27	0,00	5,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	981.448,71	0,33	0,00	5,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	54.298.915,69	18,06				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.801.326,76	1,93	0,00	0,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.801.326,76	1,93				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

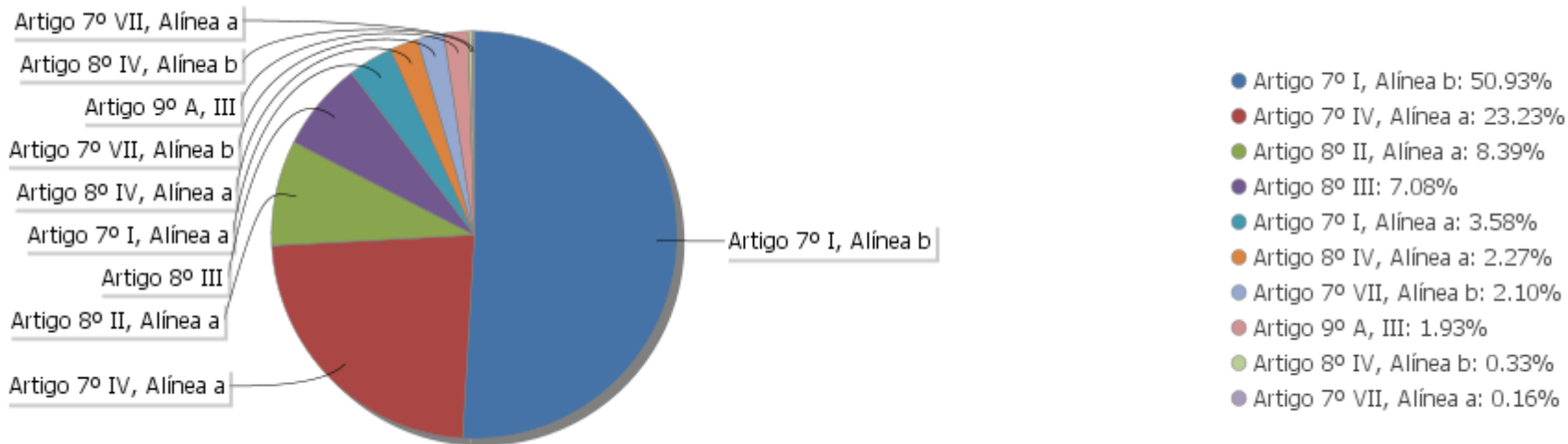
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	4,91 1.291,39	22,72 408,36	1,58 118,83	6,56 226,39		521.829,42	1.856.421,63
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,53 -402,08	10,46 187,92	2,04 153,64	4,75 164,08		-2.439.021,43	17.102.767,44
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-2,09 -548,34	12,63 227,03	2,42 181,81	6,04 208,45		-1.406.551,30	5.233.176,88
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	1,98 519,88	4,83 86,77	1,47 110,58	-4,05 -139,77		9.518,55	25.185,43
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,26 -67,86	10,57 190,01	2,49 187,65	4,90 169,21		-16.332,18	503.352,02
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,20 0,25	29,27 6,12	5,55 -1,47	17,28 5,74		298.541,78	4.832.418,42
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,35 2,40	25,55 2,40	7,41 0,39	14,36 2,82		776.727,89	4.851.944,78
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,56 6,62	-5,74 -28,89	5,48 -1,54	4,42 -7,12		479.520,55	195.763,81
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	14,48 13,53	20,56 -2,59	17,27 10,25	13,74 2,20		176.347,87	238.533,39
Artigo 9º A, III % do CDI	8,82 2.319,99	37,21 668,64	9,29 698,92	22,03 760,61		470.442,80	1.573.116,78
						-1.128.976,05	36.412.680,58

Análise de Liquidez

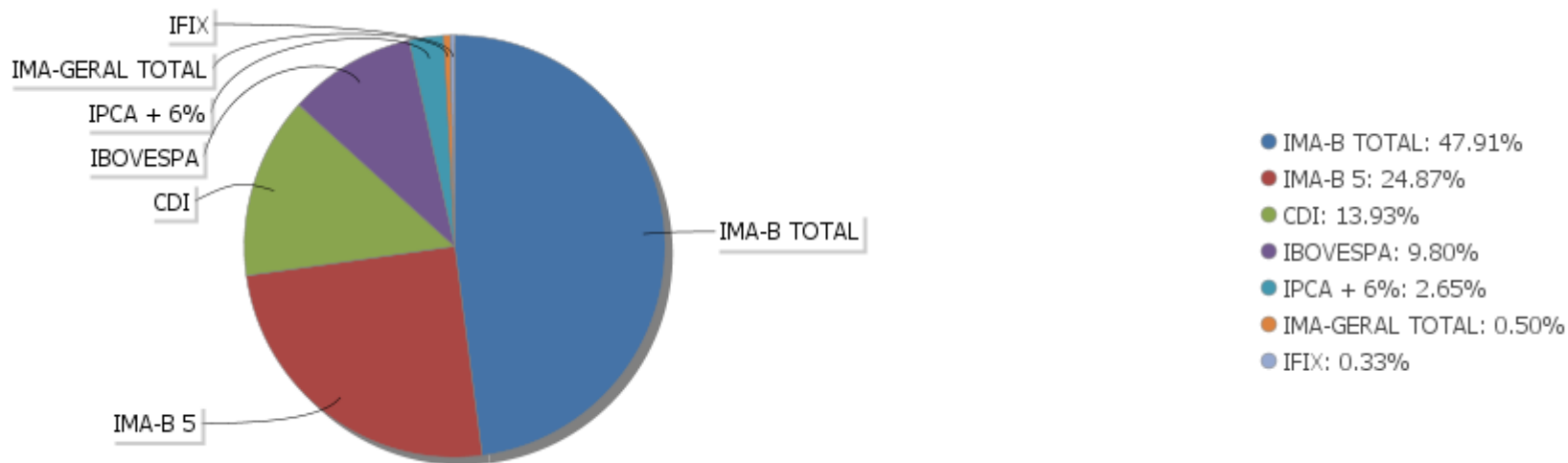
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	263.719.409,79	87,74	263.719.409,79	87,74
de 31 a 364 dias	10.966.573,48	3,65	274.685.983,27	91,38
acima de 365 dias	25.898.474,14	8,62	300.584.457,41	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

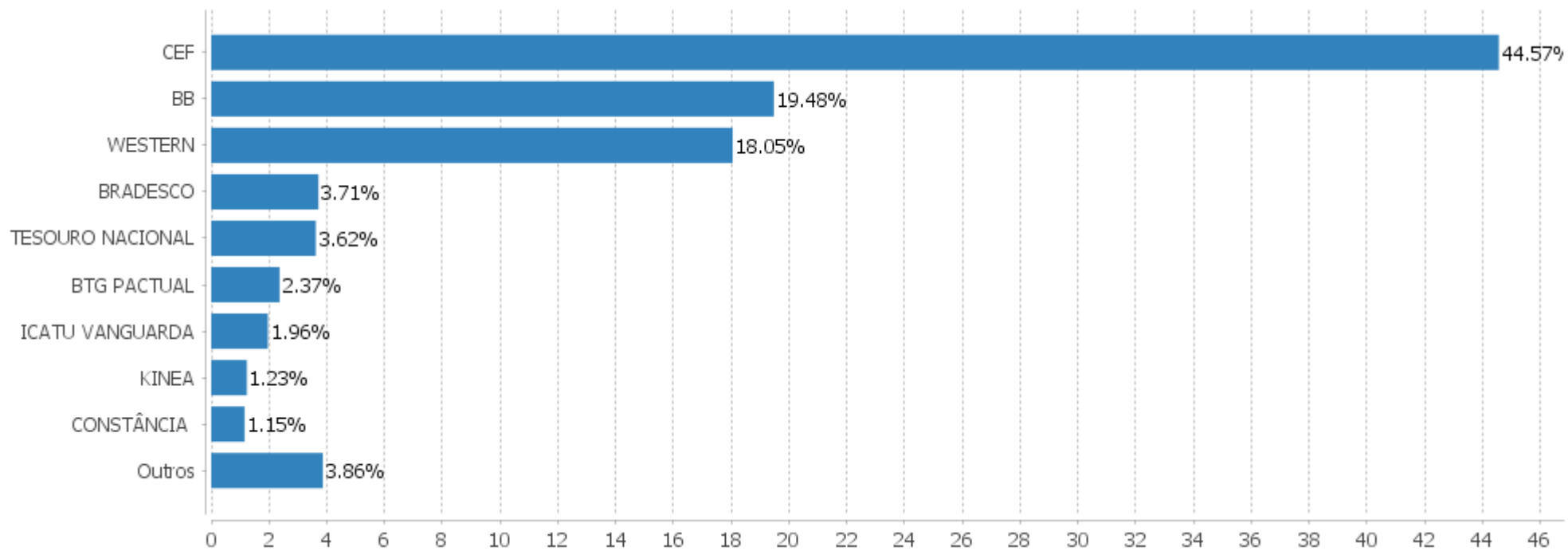


Alocação Por Estratégia



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	1,89	-0,37		13,76
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98		8,80
p.p. indexador	1,64	-0,24	-0,46	0,36	0,35	1,98	0,46	-0,50	1,04	1,25	-1,35		4,96
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

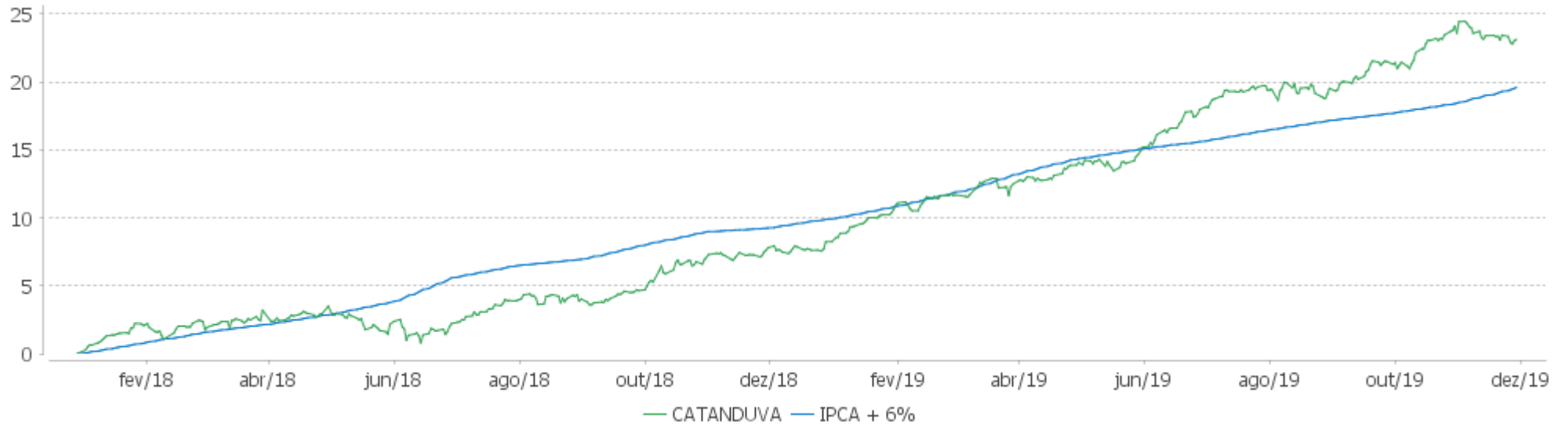
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

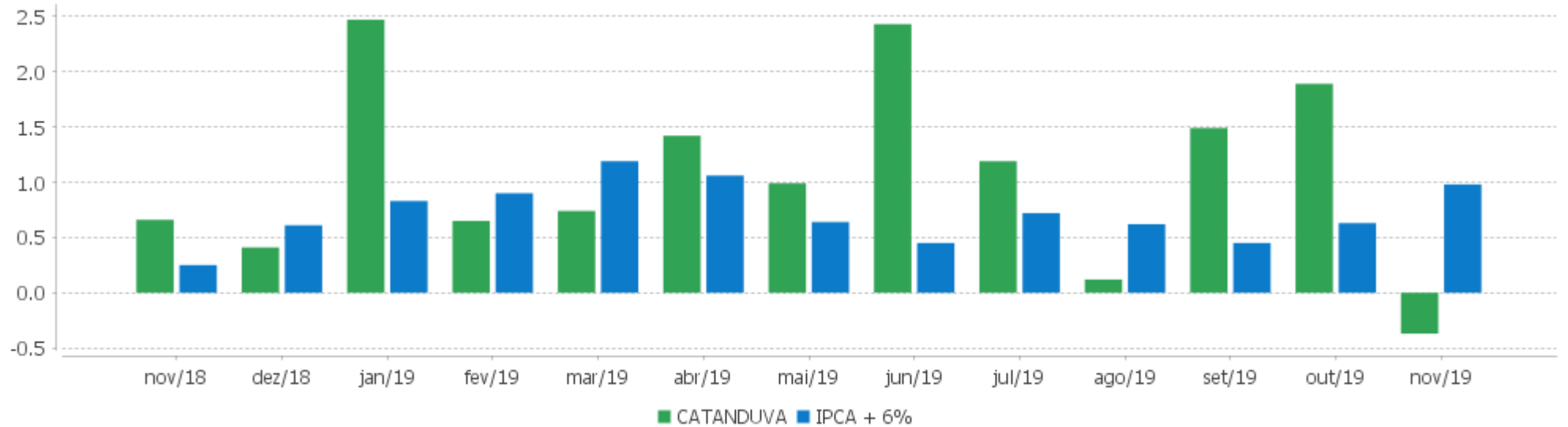
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	52,17	03 meses	3,02	2,07	0,95	3,41
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	47,83	06 meses	6,90	3,91	2,99	3,54
			12 meses	14,23	9,47	4,76	3,21
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,47	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,28	2018-05	Desde 29/12/2017	23,14	19,60	3,55	3,45

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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	-1,01 -0,72	14,34 2,57	3,59 0,46	7,07 1,10	16,77 3,47	29,28 5,40	48,36 8,18
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,54 -0,09	20,20 -0,34	3,57 -0,14	8,30 -0,23	22,16 -0,37	36,72 -0,68	57,04 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-0,34 -0,05	11,51 -0,26	3,04 -0,09	5,82 -0,15	13,05 -0,25	23,35 -0,53	39,33 -0,85
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 2,89	9,46 -11,08	2,58 -1,13	4,67 -3,86	10,73 -11,79	21,08 -16,32	36,68 -21,50
BB PREV RF TP IX Var. IMA-B 5 p.p.	0,36 0,64	5,31 -6,46	1,26 -1,87	2,76 -3,21	5,81 -7,49	13,55 -10,34	26,07 -14,10
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,75 -0,03	11,32 -0,50	2,39 -0,08	5,46 -0,25	12,61 -0,52	23,10 -1,02	40,04 -1,39
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,99 1,47	12,80 -7,73	3,60 -0,11	7,74 -0,79	14,83 -7,69	20,29 -17,11	30,71 -27,46
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,87 3,32	7,82 -12,71	2,32 -1,39	3,95 -4,58	8,82 -13,70	18,85 -18,55	28,29 -29,89
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,29 2,16	12,52 -8,02	3,08 -0,63	6,11 -2,42	14,21 -8,31	25,57 -11,83	43,80 -14,37
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,20 -53,26	-8,98 -161,41	-0,52 -38,87	-6,98 -241,08	-9,12 -149,89	-11,33 -87,53	-16,89 -67,90
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	61,70 16.220,94	7.384,25 132.706,71	19,65 1.478,08	31,15 1.075,72	5.339,01 87.735,34	200.419,80 1.547.999,66	187.846,07 755.042,46
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,11	20,43 -0,10	3,75 0,04	8,45 -0,08	22,49 -0,04	37,08 -0,33	58,16 -0,02
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,49 -0,03	20,15 -0,38	3,63 -0,08	8,35 -0,18	22,04 -0,48	36,71 -0,69	57,32 -0,85
BRADESCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2 % do CDI	-0,40 -105,10	11,01 197,86	2,76 207,27	6,09 210,46	12,85 211,12	25,22 194,78	45,80 184,09
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,29 77,53	4,52 81,26	1,06 79,37	2,33 80,57	4,95 81,28	10,54 81,40	21,06 84,67
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI % do CDI	-0,19 -50,72	7,47 134,20	1,63 122,81	3,68 127,17	8,66 142,24	17,08 131,89	30,66 123,23
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,37 96,84	5,43 97,53	1,29 97,41	2,82 97,53	5,94 97,53	12,62 97,49	24,47 98,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,31	4,75	1,12	2,46	5,20	11,09	21,83
% do CDI	82,33	85,42	83,93	84,99	85,45	85,63	87,76
BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	-0,94	11,49	2,45	5,67	12,86		
% do CDI	-246,45	206,47	184,17	195,94	211,40		
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	-0,85	10,80	2,25	4,99	12,27	23,61	42,02
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,57	-0,97	-0,88	-0,98	-1,03	-0,28	1,85
BB CRED PRIV III	-0,19	10,98	3,00	5,33	12,20	24,42	43,85
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,17	2,18	0,93	1,42	2,73	3,74	12,37
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,09	5,08	0,71	2,28	5,69	12,89	25,45
NTN-B 150545	4,89	22,55	-1,58	4,67	25,05	40,63	65,11
Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,34	2,02	-5,29	-3,86	2,53	3,23	6,93
NTN-B 150545 (4,410000%)	5,00	15,79	9,68	11,17	16,05		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,45	-4,74	5,97	2,64	-6,48		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	0,24	29,89	3,88	16,11	33,64	64,90	101,33
Var. IBOVESPA p.p.	-0,70	6,74	-3,14	4,57	12,71	14,52	26,49
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA	0,36	45,43	5,51	27,59	48,43	82,76	149,62
Var. IBOVESPA p.p.	-0,59	22,28	-1,51	16,05	27,50	32,38	74,79
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI DE AÇÕES	1,31	25,27	6,82	16,24	25,69	53,20	86,86
Var. IBOVESPA p.p.	0,36	2,12	-0,20	4,70	4,76	2,82	12,03
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4,14	35,05	8,74	28,02	41,40	79,34	146,02
Var. IBOVESPA p.p.	3,20	11,90	1,72	16,47	20,48	28,96	71,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1,90	34,35	7,90	21,91	34,31	73,20	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	0,46	32,65	5,03	14,55	35,68	67,83	94,92
Var. IBOVESPA p.p.	-0,49	9,50	-1,99	3,01	14,75	17,45	20,08
OCCAM FIC FIA	-1,16	26,12	0,56	15,19	26,25	63,71	85,28
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	2,97	-6,46	3,64	5,32	13,33	10,44
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	2,32	24,41	7,35	11,98	22,08	58,60	81,03
Var. IBOVESPA p.p.	1,37	1,26	0,33	0,44	1,15	8,22	6,19
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2,88	29,98	6,42	9,71	29,09		
Var. IBOVESPA p.p.	1,94	6,83	-0,60	-1,84	8,17		
KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME CA	15,13	30,23	13,97	11,80	24,82		
Var. IPCA + 6% p.p.	14,16	21,42	11,90	7,89	15,35		
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	-0,07	-0,97	-0,26	-0,53	-1,05	0,39	1,57
% do CDI	-17,33	-17,39	-19,20	-18,28	-17,31	3,00	6,31
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	-19,41	-15,13	-17,45	-19,93	-14,34		
Var. IFIX p.p.	-22,93	-38,04	-26,24	-33,16	-39,97		
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	-0,23	3,40	0,23	1,81	4,25	12,68	23,43
% do CDI	-59,65	61,11	17,10	62,64	69,84	97,90	94,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	3,84 1.008,71	28,92 519,74	8,39 631,25	16,13 557,02	18,52 304,36	27,94 215,84	67,98 273,23
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	8,92 7,98	36,87 13,72	10,29 3,27	23,03 11,48	26,18 5,25	57,09 6,70	82,36 7,52
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N Var. IBOVESPA p.p.	8,68 7,73	37,73 14,58	7,78 0,76	20,51 8,96	28,07 7,15	56,95 6,56	81,55 6,72
CDI	0,38	5,56	1,33	2,90	6,09	12,95	24,88
IBOVESPA	0,95	23,15	7,02	11,55	20,93	50,38	74,83
INPC + 6%	1,01	8,91	2,03	3,79	9,57	20,22	29,88
IPCA + 6%	0,98	8,80	2,07	3,91	9,47	20,68	31,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,33	6,31	1,61	3,49	6,91	14,37	27,89
IRF-M 1+	-0,83	13,42	3,27	7,53	15,61	29,19	51,70
IRF-M TOTAL	-0,46	11,34	2,69	6,32	13,05	24,82	44,64
IMA-B 5	-0,28	11,77	3,13	5,97	13,30	23,89	40,17
IMA-B 5+	-4,07	27,06	4,15	10,21	29,45	47,79	71,47
IMA-B TOTAL	-2,45	20,53	3,71	8,53	22,52	37,40	58,18
IMA-C TOTAL	-1,15	18,93	3,20	8,96	19,85	41,50	57,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,70	11,61	2,45	5,61	12,93	23,64	41,02
IMA-GERAL TOTAL	-0,71	11,82	2,47	5,71	13,13	24,13	41,42
IDKA 2	0,01	10,49	2,86	5,28	11,88	22,68	39,55
IDKA 20	-6,02	38,79	4,15	11,72	41,69	68,38	100,86
CDI	0,38	5,56	1,33	2,90	6,09	12,95	24,88
Renda Variável							
IBOVESPA	0,95	23,15	7,02	11,55	20,93	50,38	74,83
IBRX 100	0,97	24,34	6,51	11,98	22,74	52,63	78,38
IBRX 50	0,85	21,20	6,85	10,57	18,64	47,41	71,10
SMALL CAP	5,14	40,43	9,78	25,98	43,38	62,52	125,57
IFIX	3,52	22,91	8,79	13,22	25,64	30,60	57,32
Índice Consumo - ICON	2,99	43,71	3,63	23,17	43,50	38,80	70,19
Índice Dividendos - IDIV	2,35	31,98	5,87	14,68	32,84	60,60	90,05
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,51	3,12	0,57	0,88	3,27	7,45	10,47
INPC	0,54	3,22	0,53	0,76	3,37	7,04	9,13
IGPM	0,30	5,12	0,97	1,50	3,99	14,07	13,06
SELIC	0,38	5,56	1,33	2,89	6,08	12,95	24,90
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,82	6,91	1,58	2,91	7,41	16,19	24,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	0,90	7,86	1,82	3,41	8,44	18,42	27,80
IPCA + 5,5%	0,94	8,33	1,95	3,66	8,95	19,55	29,63
IPCA + 5,89%	0,97	8,70	2,04	3,86	9,36	20,43	31,07
IPCA + 6%	0,98	8,80	2,07	3,91	9,47	20,68	31,48
INPC + 4%	0,85	7,02	1,54	2,79	7,50	15,74	22,69
INPC + 6%	1,01	8,91	2,03	3,79	9,57	20,22	29,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
01/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	100.000,00	0,00	54.483,79869700	1,8354080000
01/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	284.859,96	0,00	155.202,52717600	1,8354080000
01/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	9.335,78	4.513,55989600	2,0683850920
05/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	150.009,50	81.705,36623200	1,8359810000
05/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	476,00	0,00	230,06156700	2,0690113720
05/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	475,64	229,88757200	2,0690113720
06/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	650,64	354,32755694	1,8362670000
06/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	20,15	9,73748000	2,0693238100
07/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	40.000,00	0,00	845,16010000	47,3283110000
07/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	183.309,69	99.811,81593997	1,8365530000
07/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	45.674,15	0,00	22.068,83899600	2,0696217870
08/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	166,36	90,56858518	1,8368400000
08/11/2019	BRAPRESCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2	0,00	10.551,62	6.773,34402410	1,5578154000
08/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	361,51	0,00	174,64885900	2,0699247630
11/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	20.418,31	0,00	9.862,86723600	2,0702205060
11/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	30.000,00	14.491,20995200	2,0702205060
12/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	45.000,00	950,28084000	47,3544290000
12/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	110.952,29	0,00	60.384,99195800	1,8374150000
12/11/2019	BRAPRESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	60.551,62	0,00	12.621,25670420	4,7975904000
12/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	3.969,16	1.916,97267400	2,0705355130
13/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	40.000,00	0,00	844,53866000	47,3631370000
14/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	42.130,02	22.921,77709249	1,8379910000
14/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	902.733,14	0,00	435.862,50568200	2,0711419960
18/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	537,08	0,00	292,16457300	1,8382790000
19/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	15.000,00	316,52734000	47,3892760000
19/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.241,48	5.026,46083959	1,8385660000
19/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	239.442,57	0,00	115.575,41742600	2,0717430690
20/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	34.734,22	0,00	18.889,06834800	1,8388530000

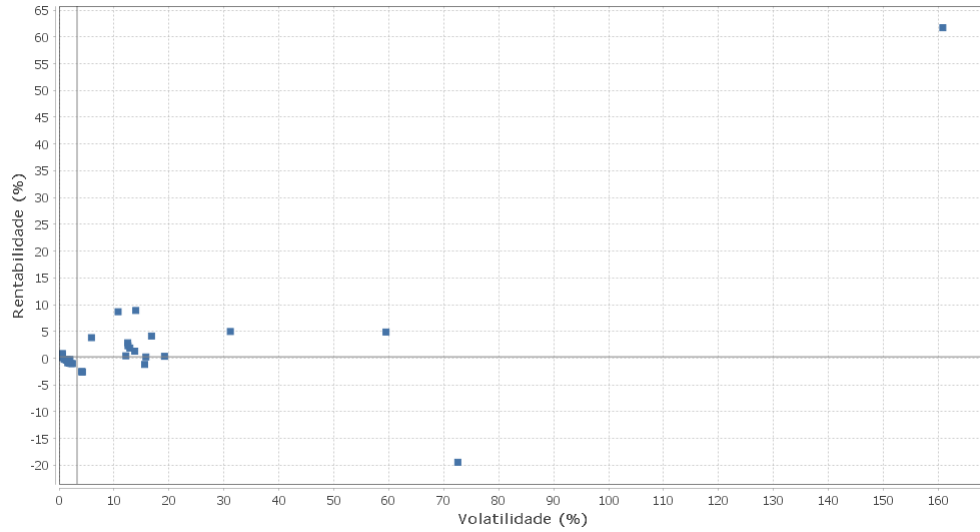
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

21/11/2019	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	5.000.000,00	1.455.071,18525100	3,4362580000
21/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.999.560,05	0,00	2.718.421,29015600	1,8391410000
22/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	20.000,00	421,80370000	47,4154210000
22/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.917.300,15	1.585.982,24556764	1,8394280000
22/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	32.079,31	15.477,32837200	2,0726645600
25/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	68.914,64	37.459,39047114	1,8397160000
25/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	11.805,23	5.694,83387500	2,0729717950
27/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	650.000,00	0,00	13.701,05677000	47,4415960000
27/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	917,44	498,52958118	1,8402920000
27/11/2019	WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	2.549.426,85	586,88901920	4.343,9675417000
27/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	2.450,32	1.181,68025600	2,0735896930
28/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	229,00	124,41730324	1,8405800000
28/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	287.248,65	0,00	138.506,51662000	2,0738998930
28/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.549.116,85	0,00	1.229.141,70476700	2,0738998930
29/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	600.000,00	12.642,47308000	47,4590690000
29/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.000,00	2.716,10853352	1,8408690000
29/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	150.000,00	81.483,25600572	1,8408690000
29/11/2019	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.645.009,50	893.604,86813565	1,8408690000
29/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	212.769,00	0,00	102.580,31442500	2,0741698950
29/11/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	5.000,00	2.410,60291700	2,0741698950

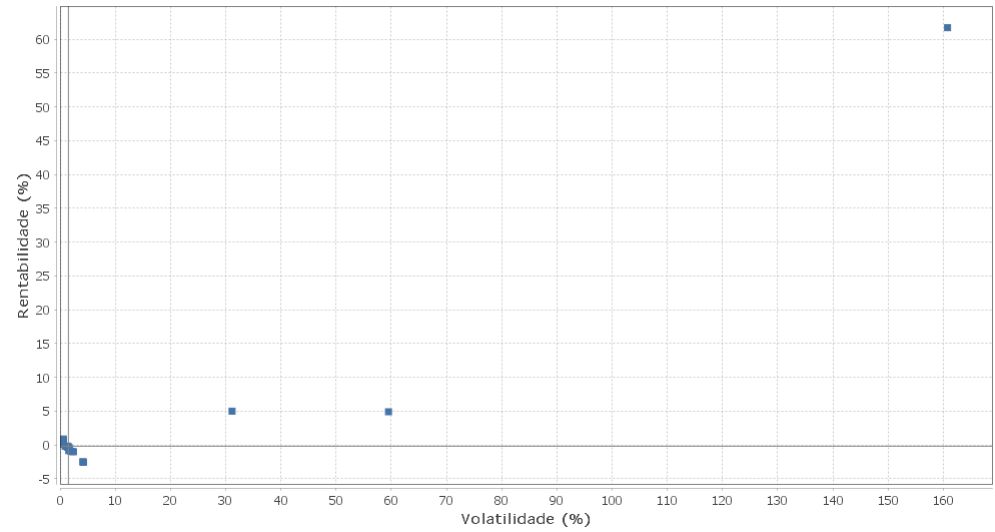
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

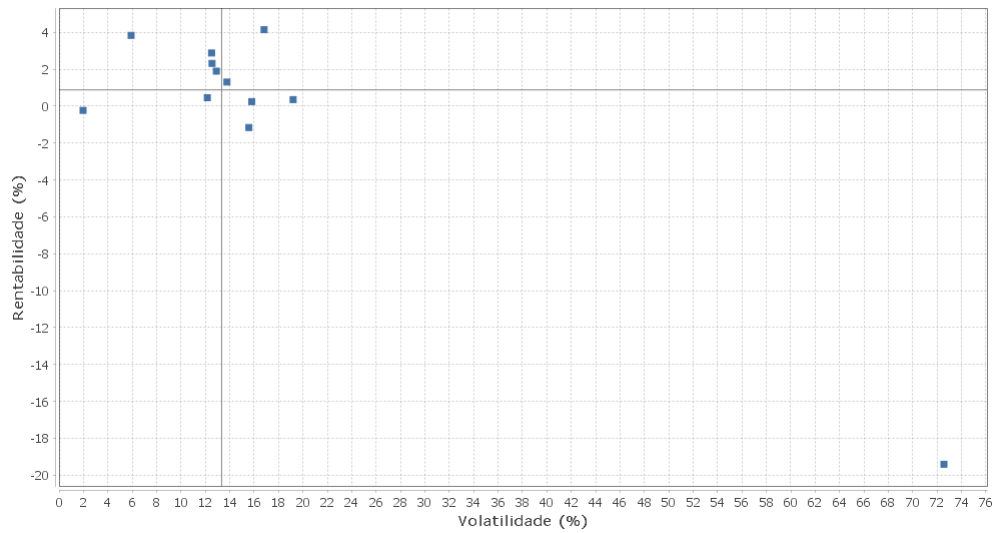
CATANDUVA - No Mês



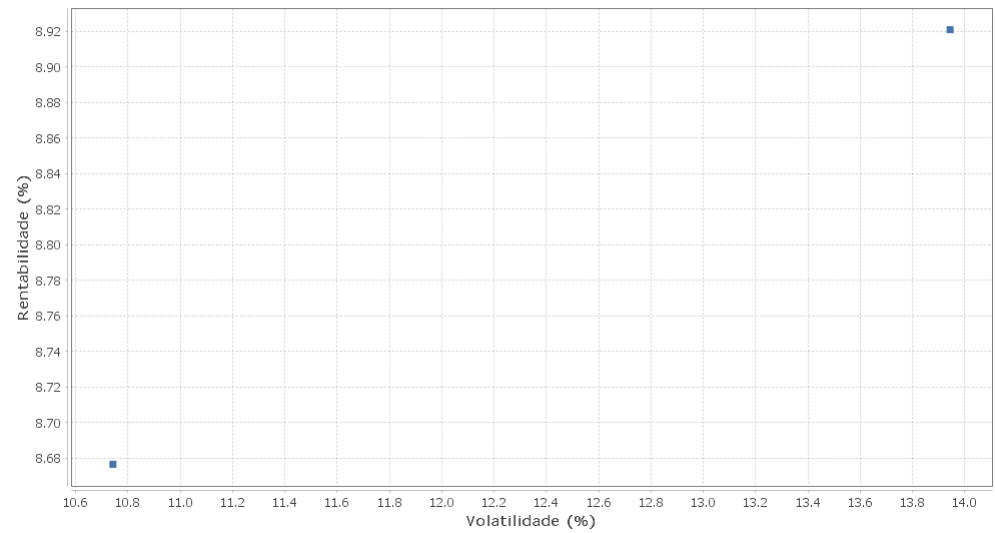
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	0,31	360.616,58	0,12
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	0,37	55.535,47	0,02
BB PREV RF TP IX	Artigo 7º I, Alínea b	0,00	0,02	0,36	1.393.660,86	0,46
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,29	4.182.259,90	1,39
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,28	0,03	0,09	1.018.186,86	0,34
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,11	0,87	1.245.361,75	0,41
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,63	0,09	0,43	256.218,70	0,09
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,93	0,09	-0,19	8.701.027,28	2,89
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,19	0,11	-0,19	4.225.771,86	1,41
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,29	0,12	-0,29	1.324.455,60	0,44
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,12	-0,34	50.123.544,64	16,68
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	1,45	0,14	-0,20	463.414,31	0,15
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	1,59	0,12	-0,85	1.067.027,55	0,35
BRADESCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	1,66	0,15	-0,40	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,69	0,14	-0,75	1.514.169,60	0,50
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,92	0,15	-0,94	3.274.051,49	1,09
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,97	0,19	-0,23	0,00	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	2,18	0,18	-0,99	1.501.857,00	0,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	0,20	-1,01	21.443.169,31	7,13
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,12	0,30	-2,49	45.498.752,34	15,14
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,20	0,31	-2,54	74.300.387,71	24,72
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,23	0,31	-2,56	7.747.547,91	2,58
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	5,91	0,80	3,84	21.270.003,95	7,08
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	Artigo 9º A, III	10,74	1,53	8,68	2.275.952,01	0,76
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,16	1,28	0,46	4.775.717,86	1,59
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,51	1,44	2,88	1.041.994,56	0,35
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,55	1,42	2,32	3.436.986,03	1,14
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	12,90	1,43	1,90	1.843.147,17	0,61
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	13,77	1,49	1,31	1.333.466,17	0,44
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,94	1,87	8,92	3.525.374,75	1,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,57	1,55	-1,16	1.332.457,76	0,44
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,80	1,65	0,24	7.028.710,34	2,34
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,82	1,95	4,14	2.782.952,28	0,93
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,20	2,01	0,36	1.650.506,83	0,55
NTN-B 150545 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	31,18	3,47	5,00	3.267.395,57	1,09
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	59,49	6,40	4,89	7.492.425,22	2,49
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Artigo 8º IV, Alínea b	72,56	6,44	-19,41	981.448,71	0,33
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	160,79	19,06	61,70	27.377,45	0,01