



**LDB**  
EMPRESAS

**CATANDUVA**  
FEVEREIRO 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 08.04.2020.

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 77,74%

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	8,09	0,45	-0,06	7.734.250,84	2,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,521000%)	3,06	0,25	1,72	3.002.383,48	0,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,410000%)	28,23	0,31	1,86	488.493,37	0,16
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>20,53</b>	<b>0,39</b>	<b>2,05</b>	<b>11.225.127,69</b>	<b>3,62</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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,44	0,69	61.174.653,62	19,70	6.609.422.706,56	0,93
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,04	0,44	0,93	1.542.052,97	0,50	1.445.830.540,62	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	0,63	1,18	51.325.184,98	16,53	9.698.235.388,71	0,53
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,15	1,03	1,94	22.165.363,25	7,14	533.375.496,94	4,16
BB	BB	BB PREV RF VII	1,19	0,41	0,61	253.331,77	0,08	676.748.275,25	0,04
BB	BB	BB PREV RF TP IX	0,05	0,27	0,63	1.407.370,71	0,45	75.436.258,46	1,87
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	3,40	0,70	1,50	1.510.947,00	0,49	213.289.312,56	0,71
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,18	0,60	1,13	1.321.643,22	0,43	550.462.426,56	0,24
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,44	0,62	0,62	8.049.249,69	2,59	10.626.779.468,55	0,08
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,80	0,25	0,21	1.224.080,30	0,39	994.853.758,21	0,12
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,45</b>	<b>0,60</b>	<b>1,07</b>	<b>149.973.877,51</b>	<b>48,30</b>		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	4,88	0,44	0,67	15.122.563,15	4,87	3.035.883.583,88	0,50
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>4,88</b>	<b>0,44</b>	<b>0,67</b>	<b>15.122.563,15</b>	<b>4,87</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
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,05	0,28	0,64	253.581,97	0,08	14.565.678.129,30	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,01	0,46	0,73	7.961.208,00	2,56	1.974.476.515,72	0,40
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,89	0,40	0,67	46.723.312,26	15,05	1.649.350.516,71	2,83
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,05	0,22	0,50	753.899,80	0,24	1.376.949.540,95	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,23	0,53	130.970,05	0,04	455.022.894,33	0,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,18	0,39	0,82	3.328.878,58	1,07	1.234.231.884,13	0,27
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,28</b>	<b>0,46</b>	<b>0,74</b>	<b>59.151.850,66</b>	<b>19,05</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	101,46	-0,18	-0,72	459.321,15	0,15	86.250.471,13	0,53
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	254,67	-1,91	-5,32	26.382,84	0,01	4.947.205,43	0,53
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>93,14</b>	<b>-0,28</b>	<b>-0,98</b>	<b>485.703,99</b>	<b>0,16</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	1,74	0,32	1,15	4.321.609,24	1,39	591.773.269,86	0,73
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	1,96	0,58	1,54	1.096.034,65	0,35	535.880.895,76	0,20
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>1,60</b>	<b>0,37</b>	<b>1,16</b>	<b>5.417.643,89</b>	<b>1,74</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,93</b>	<b>0,54</b>	<b>0,99</b>	<b>241.376.766,89</b>	<b>77,74</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,38%

## 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	18,62	-8,72	-8,71	1.303.101,24	0,42	396.618.765,14	0,33
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,61	-7,00	-6,42	4.804.695,89	1,55	1.963.717.198,95	0,24
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,19	-6,19	0,07	3.086.365,96	0,99	1.484.406.611,62	0,21
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA	18,96	-9,16	-10,00	3.149.982,52	1,01	615.683.381,90	0,51
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,63	-7,13	-5,24	7.139.186,70	2,30	1.938.091.271,83	0,37
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	18,59	-7,98	-8,61	3.410.601,32	1,10	292.097.042,05	1,17
EQUITAS	BNY MELLON	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA	20,20	-8,62	-6,30	1.709.083,23	0,55	456.890.285,09	0,37
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,49	-6,37	-8,69	3.195.884,68	1,03	909.648.393,83	0,35
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,50	-9,52	-8,66	1.307.172,33	0,42	585.852.213,57	0,22
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,26	-9,79	-9,96	1.794.432,71	0,58	4.106.559.997,95	0,04
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	18,81	-8,96	-10,27	1.017.306,22	0,33	798.991.874,74	0,13
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	20,09	-8,39	-9,41	3.664.772,28	1,18	152.667.267,18	2,40
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>17,42</b>	<b>-7,75</b>	<b>-6,45</b>	<b>35.582.585,08</b>	<b>11,46</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 US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15,04	-7,50	-7,16	20.262.968,06	6,53	814.886.135,28	2,49
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>15,04</b>	<b>-7,50</b>	<b>-7,16</b>	<b>20.262.968,06</b>	<b>6,53</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	84,38	-0,13	-0,28	1.941.620,88	0,63	351.654.832,44	0,55
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME CA	76,00	22,34	21,81	4.695.432,90	1,51	199.712.396,49	2,35
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>33,20</b>	<b>14,79</b>	<b>14,40</b>	<b>6.637.053,78</b>	<b>2,14</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	51,65	-0,88	-0,32	806.903,81	0,26	58.603.257,94	1,38
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>51,65</b>	<b>-0,88</b>	<b>-0,32</b>	<b>806.903,81</b>	<b>0,26</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>12,91</b>	<b>-5,60</b>	<b>-4,74</b>	<b>63.289.510,73</b>	<b>20,38</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,88%

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	16,34	-5,69	0,46	3.479.384,18	1,12	866.229.995,42	0,40
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	15,37	-1,97	5,27	2.358.024,04	0,76	461.830.097,53	0,51
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>15,37</b>	<b>-4,22</b>	<b>2,35</b>	<b>5.837.408,22</b>	<b>1,88</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>15,37</b>	<b>-4,22</b>	<b>2,35</b>	<b>5.837.408,22</b>	<b>1,88</b>		
<b>Total</b>						<b>310.503.685,84</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	11.225.127,69	3,62	0,00	4,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	149.973.877,51	48,30	0,00	37,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	15.122.563,15	4,87	0,00	0,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	59.151.850,66	19,05	0,00	22,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	485.703,99	0,16	0,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	5.417.643,89	1,74	0,00	5,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>241.376.766,89</b>	<b>77,74</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	35.582.585,08	11,46	0,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	20.262.968,06	6,53	0,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	6.637.053,78	2,14	0,00	4,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	806.903,81	0,26	0,00	2,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>63.289.510,73</b>	<b>20,38</b>				
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.837.408,22	1,88	0,00	3,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>5.837.408,22</b>	<b>1,88</b>				



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

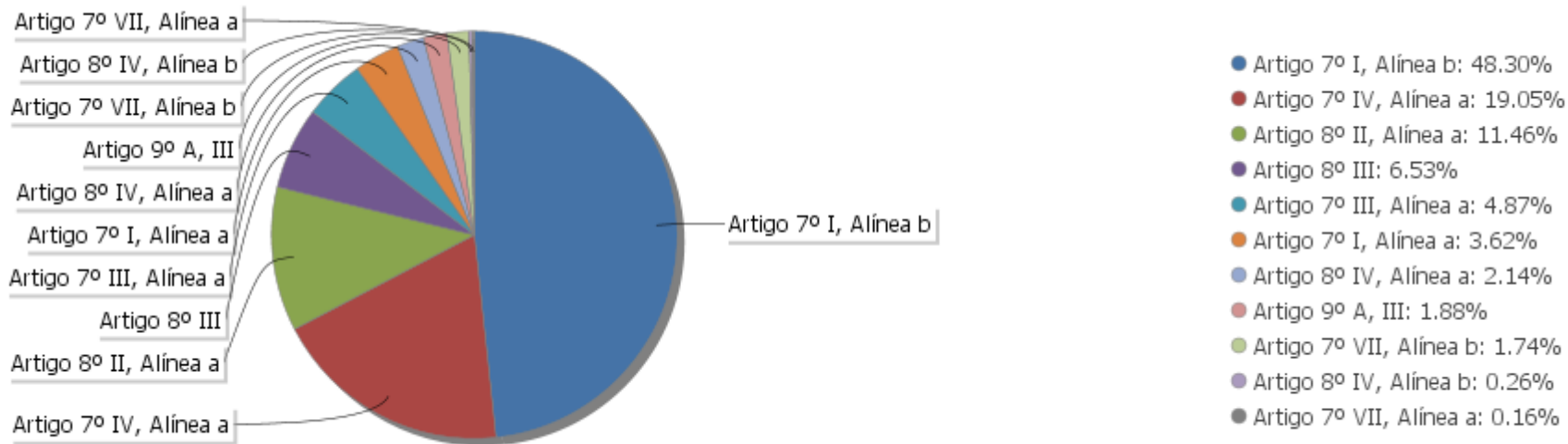
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,39 132,84	2,05 305,47	4,32 412,38	5,97 249,69	18,56 332,94	43.627,49	225.613,86
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,60 204,42	1,07 158,93	2,70 257,60	4,80 200,63	11,07 198,55	896.280,55	1.554.743,13
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,44 148,23	0,67 99,17				65.555,78	95.524,73
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,46 155,99	0,74 109,79	2,46 234,32	4,93 206,26	12,39 222,21	241.625,92	464.524,59
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,28 -95,06	-0,98 -146,33	-1,04 -98,85	0,42 17,47	0,98 17,59	-1.359,94	-4.819,45
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,37 126,16	1,16 172,31	2,15 204,68	4,69 196,26	10,64 190,94	20.002,62	68.967,29
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,75 0,68	-6,45 3,47	1,22 4,97	6,83 3,83	22,88 13,90	-2.820.098,20	-2.556.701,24
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-7,50 0,93	-7,16 2,76	-4,73 -0,98	2,33 -0,68	8,74 -0,25	-1.643.706,83	-1.563.574,21
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	14,79 23,22	14,40 24,32	-2,70 1,05	2,63 -0,38	-7,02 -16,00	854.984,71	835.344,46
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,88 7,55	-0,32 9,60	-17,78 -14,03	-3,59 -6,59	-3,23 -12,21	-7.125,70	-2.626,43
Artigo 9º A, III % do CDI	-4,22 -1.436,30	2,35 350,21	0,62 59,31	9,97 416,83	29,65 531,99	-257.116,05	134.113,80
						-2.607.329,65	-748.889,47

## Análise de Liquidez

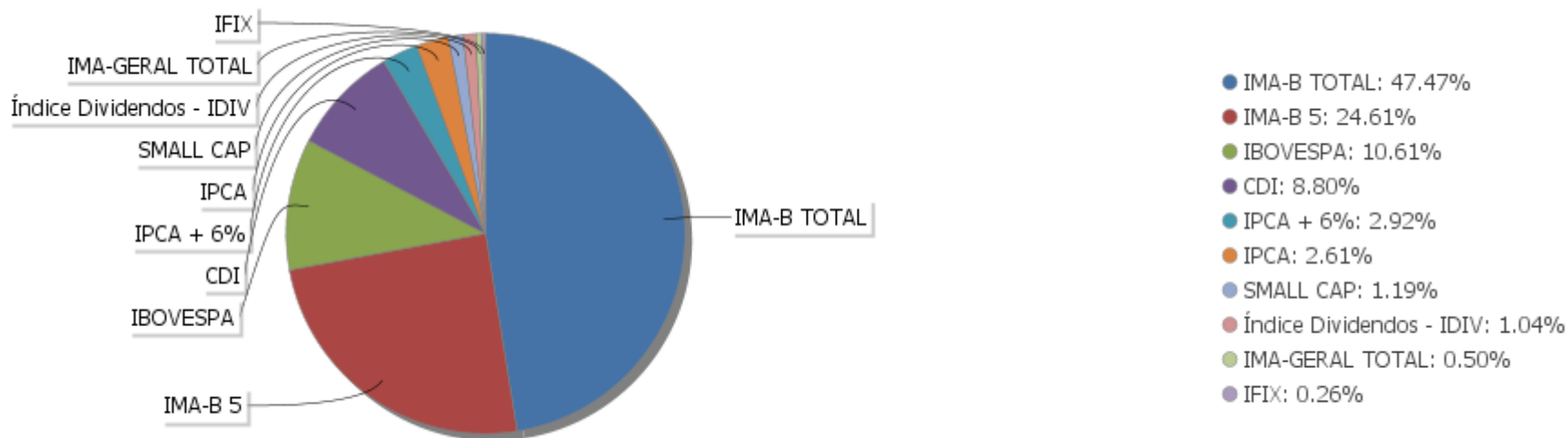
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	268.320.712,65	86,41	268.320.712,65	86,41
de 31 a 364 dias	16.079.973,84	5,18	284.400.686,49	91,59
acima de 365 dias	26.102.999,35	8,41	310.503.685,84	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

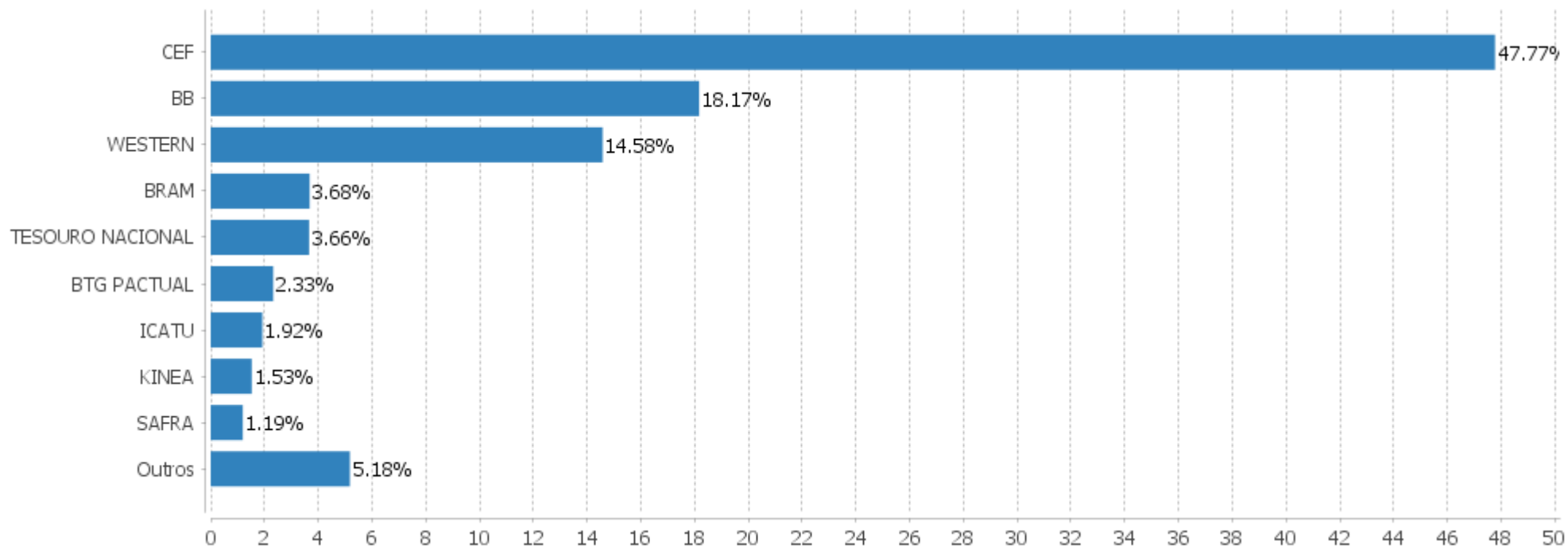


Alocação Por Estratégia



## 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	0,60	-0,83											-0,24
IPCA + 5,89%	0,71	0,66											1,38
p.p. indexador	-0,11	-1,49											-1,61
2019	2,47	0,65	0,74	1,42	0,99	2,43	1,19	0,12	1,49	1,89	-0,37	1,75	15,75
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,64	-0,24	-0,46	0,36	0,35	1,98	0,46	-0,50	1,04	1,25	-1,35	0,11	5,16
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

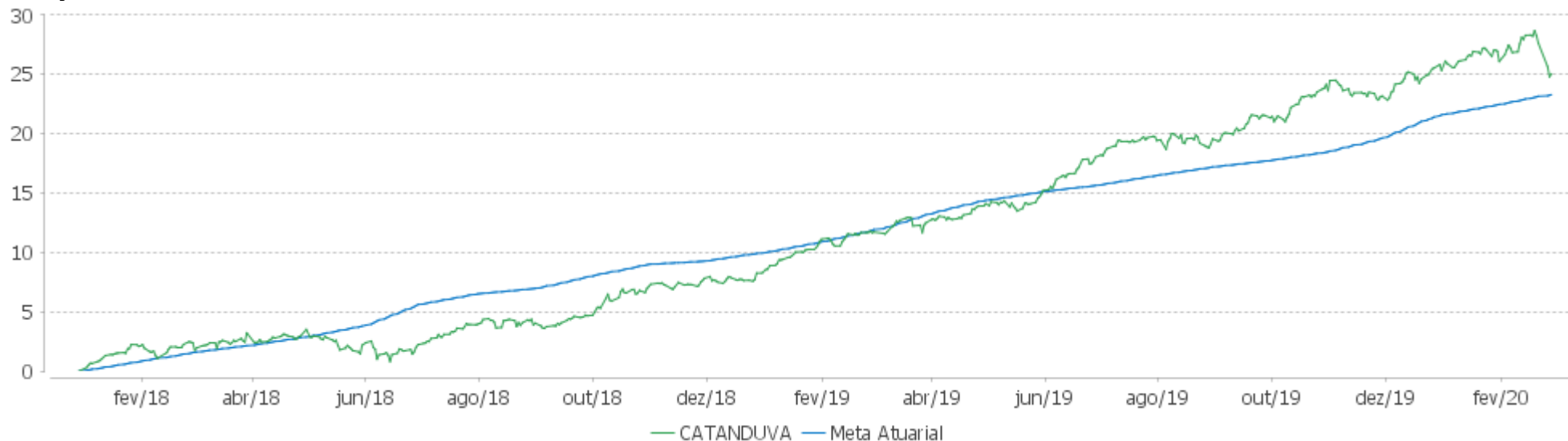
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

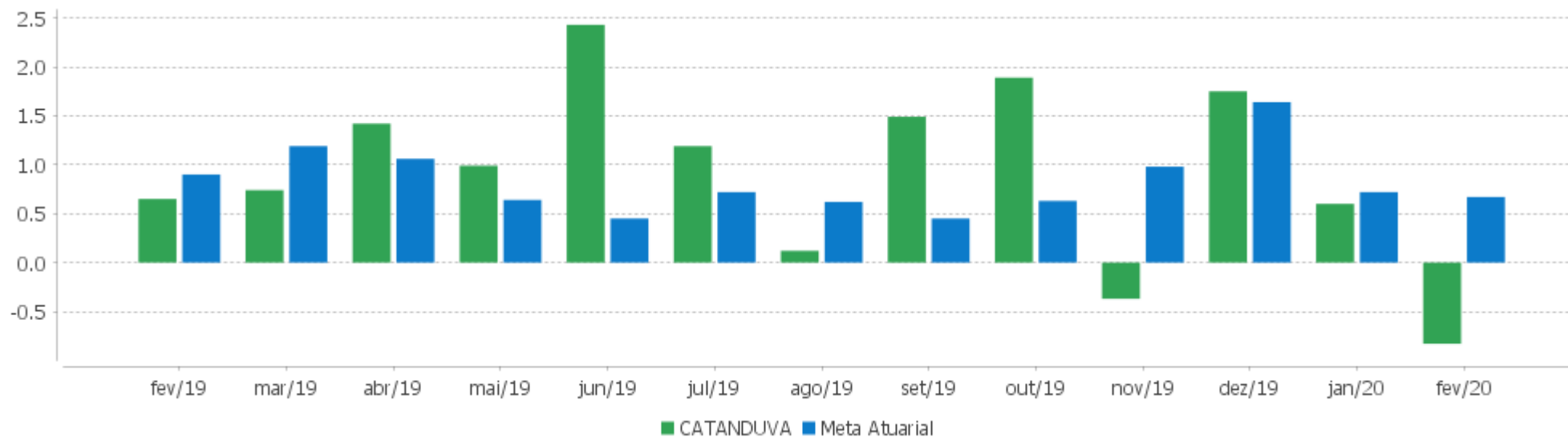
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	50,00	03 meses	1,51	3,04	-1,53	5,69
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	50,00	06 meses	4,58	5,17	-0,60	4,65
			12 meses	11,96	10,20	1,76	4,10
			24 meses	22,11	21,36	0,75	3,83
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,47	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,28	2018-05	Desde 29/12/2017	25,00	23,23	1,77	3,76

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
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,67 -0,05	2,67 -0,06	6,36 -0,18	17,53 -0,47	33,98 -0,67	47,95 -1,32
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,18 -62,60	-0,72 -107,46	-0,88 -84,23	-1,40 -58,34	-9,51 -170,56	-13,07 -105,92	-16,73 -74,70
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-1,91 -650,41	-5,32 -791,61	-3,63 -346,44	15,30 639,69	1.319,65 23.674,52	1.505,31 12.198,27	182.995,12 817.216,96
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 0,38	1,94 0,73	3,37 0,92	7,08 1,42	15,24 3,07	28,81 5,32	45,44 7,48
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,69 -0,03	2,69 -0,04	6,35 -0,19	17,63 -0,37	34,00 -0,65	48,25 -1,02
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,18 -0,03	2,40 -0,05	5,51 -0,15	11,87 -0,29	22,95 -0,54	37,12 -0,84
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,04	0,61 -0,10	1,53 -1,20	4,15 -2,39	9,09 -8,91	20,06 -14,60	33,19 -16,08
BB PREV RF TP IX Var. IMA-B 5 p.p.	0,27 -0,37	0,63 -0,57	0,98 -1,47	2,26 -3,40	5,30 -6,87	12,81 -10,68	23,45 -14,51
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	0,62 0,37	1,44 0,98	2,04 0,43	5,45 3,26	14,23 10,23	25,27 17,21	37,87 26,74
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,93 -0,08	1,84 -0,07	4,27 -0,16	10,80 -0,48	21,36 -1,00	34,51 -1,37
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,25	1,50 0,79	3,02 0,28	6,73 0,18	16,04 -1,96	25,25 -9,40	32,81 -16,45
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,20	0,21 -0,50	1,00 -1,73	3,34 -3,20	7,18 -10,82	16,82 -17,83	27,29 -21,98
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,60 0,15	1,13 0,42	2,33 -0,40	5,48 -1,06	12,52 -5,48	24,18 -10,47	39,12 -10,15
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,73 0,02	2,76 0,03	6,61 0,07	17,85 -0,15	34,37 -0,29	48,92 -0,35
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,05	0,67 -0,04	2,69 -0,04	6,42 -0,13	17,63 -0,37	33,97 -0,69	48,34 -0,92
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 73,69	0,50 74,86	0,79 75,23	1,85 77,44	4,45 79,85	9,95 80,64	18,58 82,98
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,28	0,64	1,01	2,31	5,42	12,01	21,98

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	93,97	95,23	95,86	96,71	97,19	97,31	98,17
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,23 78,51	0,53 79,49	0,84 80,23	1,97 82,21	4,70 84,24	10,48 84,92	19,40 86,63
BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	0,39 132,79	0,82 122,20	1,67 159,69	4,16 174,08	10,71 192,17	21,41 173,53	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,06	1,54 0,33	2,72 0,27	5,03 -0,63	11,41 -0,76	23,43 -0,06	39,22 1,26
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	0,32 -0,35	1,15 -0,24	2,27 -0,79	5,33 0,14	11,18 0,96	23,55 2,17	39,64 7,41
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09 -0,36	-0,06 -0,78	3,01 0,28	7,18 0,63	23,48 5,48	42,47 7,82	56,44 7,18
NTN-B 150545 (3,521000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,20	1,72 1,01	2,35 -0,38	1,43 -5,11	3,10 -14,90		
NTN-B 150545 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,31 -0,14	1,86 1,15	2,73 0,00	12,67 6,13	17,41 -0,59		
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,13 -43,32	-0,28 -41,77	-38,50 -3.671,79	-38,66 -1.616,41	-38,99 -699,50	-38,30 -310,37	-37,31 -166,61
KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME CA Var. IPCA + 6% p.p.	22,34 21,67	21,81 20,42	28,14 25,09	46,04 40,85	81,05 70,83		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-7,50 -2.554,49	-7,16 -1.066,88	-4,73 -451,48	3,26 136,25	10,30 184,80	17,58 142,47	45,11 201,46
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII Var. IFIX p.p.	-0,88 2,81	-0,32 6,99	0,97 -1,57	-9,13 -20,69	-8,79 -30,53	-1,07 -29,29	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,13 1,30	-5,24 4,68	1,57 5,32	5,51 2,51	24,91 15,92	47,72 25,67	92,53 36,26
FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	-9,16 -0,73	-8,14 1,78	0,46 4,21	6,52 3,52	25,11 16,13	48,30 26,25	75,82 19,55
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,62 -0,19	-6,30 3,62	3,55 7,30	9,25 6,25	41,12 32,13	67,51 45,46	113,82 57,55
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-8,72 -0,29	-8,71 1,21	-2,28 1,48	4,38 1,38	12,95 3,97	27,98 5,93	65,70 9,43
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,19 2,24	0,07 9,99	10,90 14,66	20,59 17,59	44,87 35,89	70,86 48,81	128,55 72,29
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-9,79	-9,96	-2,64	5,05	20,11	42,38	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,00 1,43	-6,42 3,50	0,61 4,36	5,66 2,66	21,20 12,22	49,95 27,91	85,08 28,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,37 -0,19	-4,94 2,72	3,17 1,61	8,42 0,89	19,87 -1,76	41,01 -1,30	75,29 7,68
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-9,52 -1,09	-8,66 1,27	-1,90 1,86	-1,35 -4,35	14,90 5,91	33,22 11,17	72,91 16,64
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA Var. SMALL CAP p.p.	-8,39 -0,11	-8,00 -0,15	2,29 -1,51	12,91 -1,04	35,25 -0,44		
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,98 0,44	-8,61 1,31	-0,77 2,99	6,52 3,52	12,73 3,74	31,52 9,48	65,88 9,62
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,96 -0,53	-10,27 -0,35	-2,37 1,38	3,90 0,90	13,67 4,69	34,53 12,49	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-5,69 2,74	0,46 10,38	-1,30 2,45	8,85 5,84	26,84 17,86	48,66 26,61	81,60 25,33
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N Var. IBOVESPA p.p.	-1,97 6,46	5,27 15,19	3,61 7,36	11,67 8,67	34,04 25,06	59,10 37,05	92,09 35,82
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23



**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	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00		0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,54	6,84	14,98	14,49
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
<b>Meta Atuarial</b>							
IPCA + 4%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54
IPCA + 5,5%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 4%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

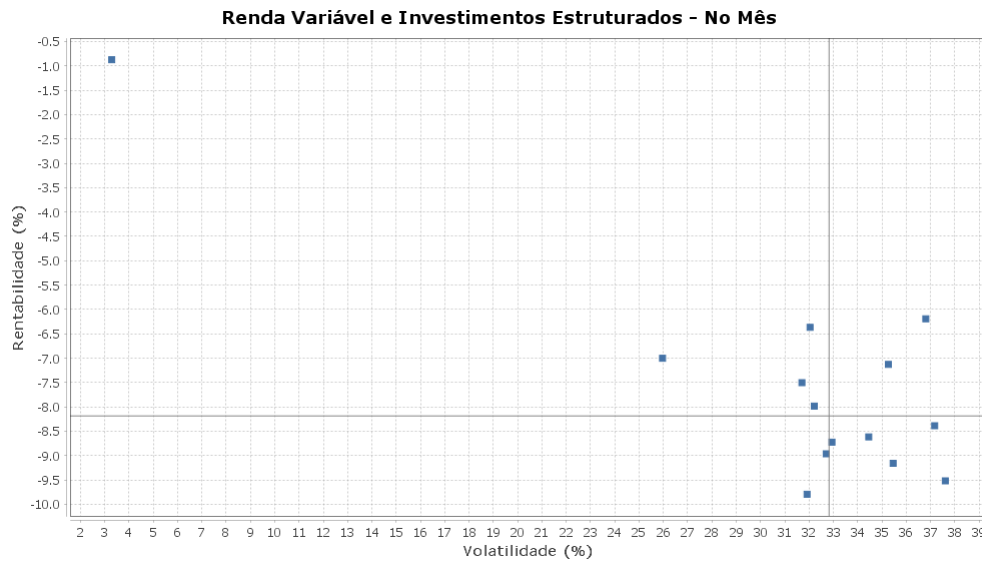
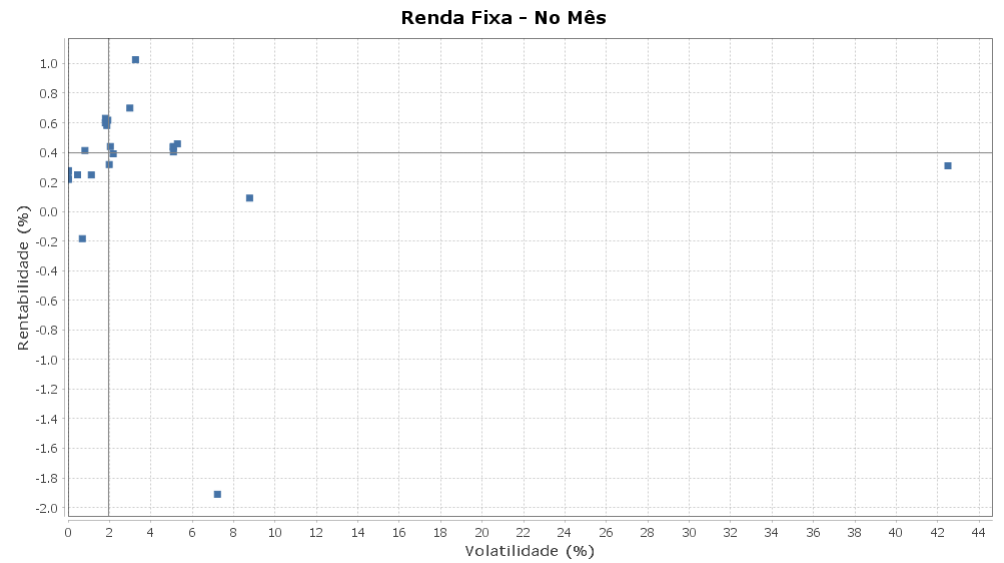
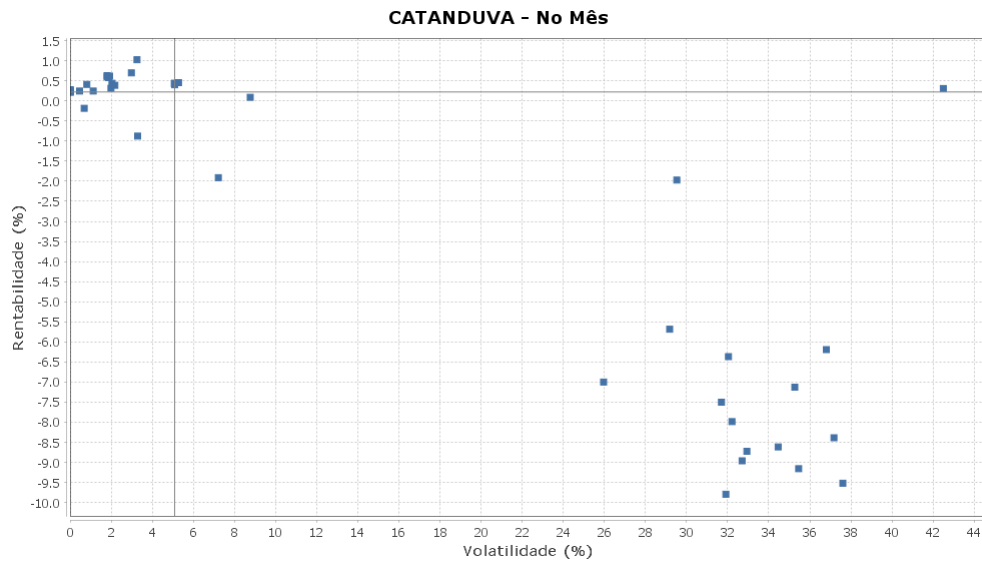
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
03/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	953,60	0,00	457,07155300	2,0863254190
03/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	5.000,00	104,57600110	47,8121170000
03/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	280.000,00	0,00	151.159,99097300	1,8523420000
04/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	120.212,32	64.888,57862400	1,8525960000
05/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	700,00	335,42997900	2,0868736980
07/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	43.592,95	0,00	20.884,07652200	2,0873774310
07/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	96,15	46,06258500	2,0873774310
07/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	650,81	351,15432200	1,8533410000
10/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	108,45	0,00	51,94915200	2,0876182650
10/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	9.870,89	4.728,30218300	2,0876182650
10/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	20.814,15	0,00	11.229,21041100	1,8535720000
12/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	9.824,02	4.704,71356700	2,0881228710
12/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	8.000,00	0,00	167,13662002	47,8650340000
12/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	139.930,23	0,00	75.473,43008400	1,8540330000
13/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	16.526,83	0,00	7.913,71135100	2,0883791770
13/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	8.000,00	167,11092410	47,8723940000
13/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	46.094,80	24.858,82464300	1,8542630000
14/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.859.590,65	0,00	2.326.697,09871900	2,0886219580
17/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	891.654,09	426.859,77546800	2,0888688540
17/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	39.829,10	0,00	19.067,30521800	2,0888688540
17/02/2020	BB PREV RF VII	0,00	6.807,54	3.889,04317200	1,7504408410
17/02/2020	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	33.711,56	18.258,36376900	1,8463626000
17/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	15.000,00	313,23683745	47,8870880000
17/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	48,62	0,00	26,21412800	1,8547250000
18/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	2.763.702,71	1.322.905,48898600	2,0891157630
18/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	34.825,08	16.669,77034800	2,0891157630
18/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	69.869,53	0,00	37.666,38795400	1,8549570000
19/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	32.694,60	0,00	15.648,06360900	2,0893703410

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
19/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	2.500.000,00	0,00	52.190,15244055	47,9017570000
20/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	164,19	0,00	78,57466700	2,0896047640
20/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	2.700.000,00	56.357,02433743	47,9088460000
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	268,82	144,86497400	1,8556530000
26/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.825.000,00	873.183,58574200	2,0900530310
26/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	63.615,58	0,00	30.437,30424800	2,0900530310
26/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	150.000,00	0,00	3.130,08194888	47,9220680000
26/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	65.121,34	35.089,08417900	1,8558860000
27/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	582.501,52	0,00	278.667,73748600	2,0903084270
27/02/2020	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	1.825.000,00	0,00	9.632,55380500	189,4616980000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	268,82	144,82880600	1,8561210000
28/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	10,13	0,00	4,84565500	2,0905323110
28/02/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	100.000,00	2.086,10724752	47,9361740000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	150.000,00	80.803,42725700	1,8563570000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF TP IX	Artigo 7º I, Alínea b	0,01	0,02	0,27	1.407.370,71	0,45
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,23	130.970,05	0,04
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,28	253.581,97	0,08
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,22	753.899,80	0,24
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,06	0,25	1.224.080,30	0,39
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,69	0,06	-0,18	459.321,15	0,15
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,82	0,11	0,41	253.331,77	0,08
NTN-B 150545 (3,521000%)	Artigo 7º I, Alínea a	1,12	0,13	0,25	3.002.383,48	0,97
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,60	1.321.643,22	0,43
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	51.325.184,98	16,53
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	1,88	0,23	0,58	1.096.034,65	0,35
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,62	8.049.249,69	2,59
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,99	0,22	0,32	4.321.609,24	1,39
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	0,24	0,44	1.542.052,97	0,50
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,18	0,25	0,39	3.328.878,58	1,07
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	2,98	0,35	0,70	1.510.947,00	0,49
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	3,26	0,39	1,03	22.165.363,25	7,14
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	3,29	0,29	-0,88	806.903,81	0,26
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,07	0,55	0,44	15.122.563,15	4,87
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,09	0,55	0,40	46.723.312,26	15,05
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,44	61.174.653,62	19,70
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,28	0,57	0,46	7.961.208,00	2,56
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	7,22	0,64	-1,91	26.382,84	0,01
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,77	0,91	0,09	7.734.250,84	2,49
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,96	2,29	-7,00	4.804.695,89	1,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	29,18	2,70	-5,69	3.479.384,18	1,12
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	Artigo 9º A, III	29,53	2,95	-1,97	2.358.024,04	0,76
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	31,70	2,85	-7,50	20.262.968,06	6,53
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	31,91	2,73	-9,79	1.794.432,71	0,58
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	2,95	-6,37	3.195.884,68	1,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,21	2,88	-7,98	3.410.601,32	1,10
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,70	2,87	-8,96	1.017.306,22	0,33
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	32,94	2,91	-8,72	1.303.101,24	0,42
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	34,45	3,07	-8,62	1.709.083,23	0,55
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	35,27	3,24	-7,13	7.139.186,70	2,30
FI ACOES CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	35,46	3,14	-9,16	3.149.982,52	1,01
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	36,80	3,46	-6,19	3.086.365,96	0,99
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	37,17	3,36	-8,39	3.664.772,28	1,18
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	37,61	3,34	-9,52	1.307.172,33	0,42
NTN-B 150545 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	42,50	4,42	0,31	488.493,37	0,16