



CARAGUATATUBA
JANEIRO 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 05.03.2020.

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

RENTA FIXA

86,61%

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-M	2,06	0,85	0,85	15.641.049,08	3,22	5.205.249.143,09	0,30
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,25	0,43	0,43	24.655.609,12	5,08	199.896.141,21	12,33
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,89	0,24	0,24	16.052.465,30	3,31	379.812.548,39	4,23
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,42	0,42	25.893.285,26	5,33	7.374.284.212,96	0,35
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,25	0,25	14.078.678,31	2,90	6.604.088.892,56	0,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,25	0,40	0,40	4.306.124,34	0,89	164.899.848,61	2,61
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,27	0,05	0,05	23.928.885,08	4,93	2.287.850.661,28	1,05
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	7,28	0,01	0,01	4.290.760,62	0,88	105.925.344,46	4,05
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,28	-0,04	-0,04	51.557.135,97	10,62	2.270.256.483,13	2,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	2,93	1,08	1,08	13.248.355,40	2,73	2.361.861.808,09	0,56
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,50	0,46	0,46	56.881.589,03	11,72	8.791.015.868,25	0,65
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	2,10	0,84	0,84	6.676.886,00	1,38	15.527.608.259,67	0,04
BB	BB	BB PREV RF VII	1,23	0,20	0,20	1.334.656,63	0,27	692.095.869,22	0,19
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,67	0,82	0,82	16.910.873,35	3,48	10.136.705.212,45	0,17
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,83	-0,03	-0,03	51.742.480,00	10,66	1.019.720.781,29	5,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,49	0,31	0,31	327.198.833,49	67,39		

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 INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,07	0,37	0,37	7.298.208,64	1,50	1.204.880.496,76	0,61
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,33	0,21	0,21	40.737.108,36	8,39	334.060.563,28	12,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,37	0,37	3.291.286,95	0,68	5.345.385.558,02	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,87	0,34	0,34	41.856.362,79	8,62	5.214.674.759,25	0,80
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,83	0,29	0,29	93.182.966,74	19,19		

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
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	268,17	-3,47	-3,47	128.316,56	0,03	5.224.926,57	2,46
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			268,17	-3,47	-3,47	128.316,56	0,03		

Renda Fixa			2,36	0,31	0,31	420.510.116,79	86,61		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,39%

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
BB	BB	BB PREV ACOES GV	17,55	-1,09	-1,09	24.725.243,45	5,09	826.438.302,84	2,99
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			17,55	-1,09	-1,09	24.725.243,45	5,09		

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	BRABESCO F I A SELECTION	18,43	-1,29	-1,29	6.156.826,81	1,27	971.708.914,14	0,63
BB	BB	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	16,73	-0,42	-0,42	1.728.224,08	0,36	1.176.739.396,25	0,15
BRAM	BEM	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	15,95	1,61	1,61	6.964.465,80	1,43	2.245.635.949,92	0,31
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	16,62	0,68	0,68	8.847.137,74	1,82	889.485.663,39	0,99
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	16,65	1,95	1,95	7.943.590,01	1,64	416.277.976,10	1,91
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,73	1,53	1,53	2.006.007,86	0,41	943.947.729,59	0,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	16,69	-0,19	-0,19	6.636.738,24	1,37	4.585.787.416,19	0,14
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,13	0,63	0,63	40.282.990,54	8,30		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,30	-0,03	-0,03	65.008.233,99	13,39		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

Total						485.518.350,78	100,00		
--------------	--	--	--	--	--	-----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	327.198.833,49	67,39	10,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	93.182.966,74	19,19	1,00	10,00	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	128.316,56	0,03	0,01	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	420.510.116,79	86,61				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	24.725.243,45	5,09	10,00	15,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	40.282.990,54	8,30	10,00	15,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	65.008.233,99	13,39				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

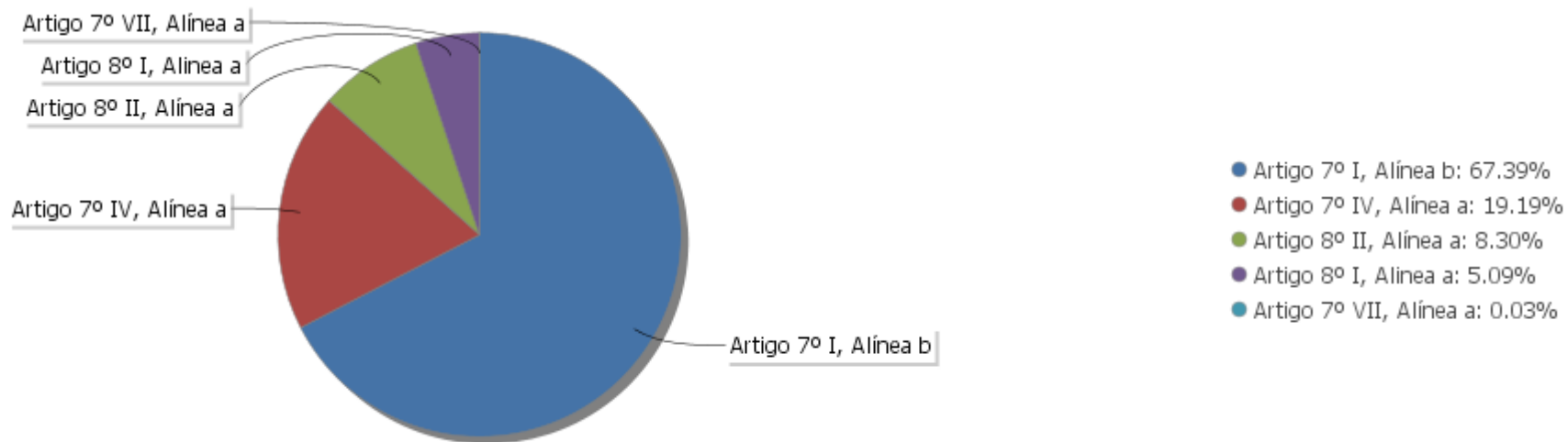
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,31 82,74	0,31 82,74	0,44 38,48	4,45 170,92	12,13 209,75	1.023.910,83	1.023.910,83
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,29 78,07	0,29 78,07	0,54 47,44	3,61 138,59	10,75 185,90	272.007,22	272.007,22
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-3,47 -921,66	-3,47 -921,66	58,86 5.181,62	14,72 565,35	4.493,91 77.688,87	-4.614,29	-4.614,29
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,09 0,54	-1,09 0,54	7,44 1,34	14,40 2,66	20,60 3,80	-271.664,59	-271.664,59
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,63 2,26	0,63 2,26	11,33 5,23	18,46 6,73	29,48 12,67	252.088,03	252.088,03
						1.271.727,20	1.271.727,20

Análise de Liquidez

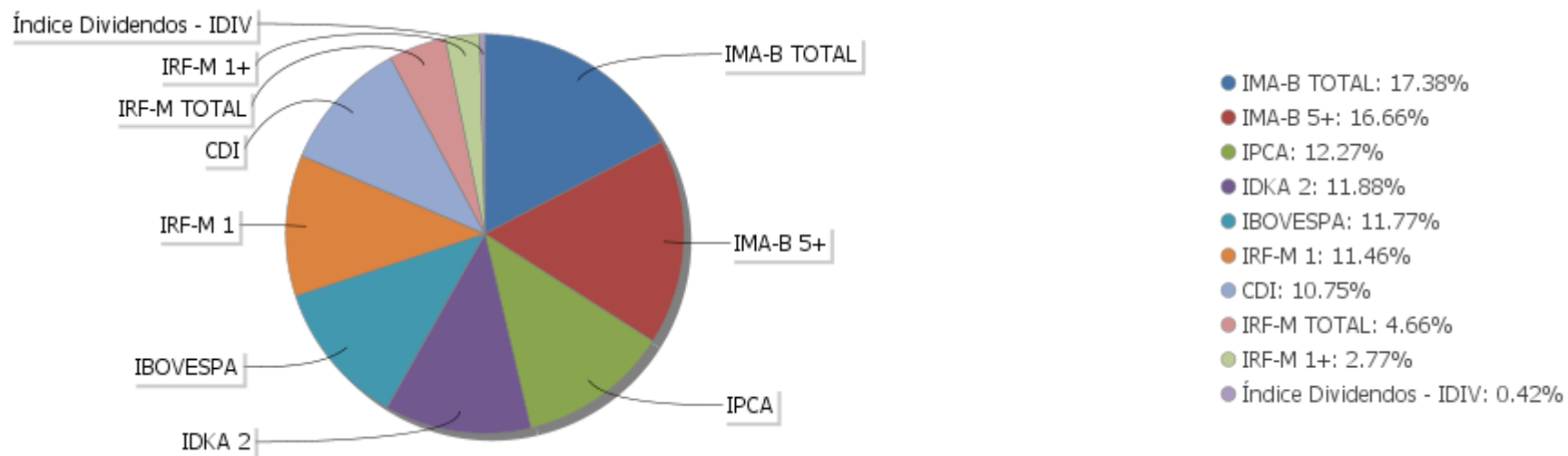
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	415.726.561,48	85,63	415.726.561,48	85,63
de 31 a 364 dias	68.328.816,11	14,07	484.055.377,59	99,70
acima de 365 dias	1.462.973,19	0,30	485.518.350,78	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

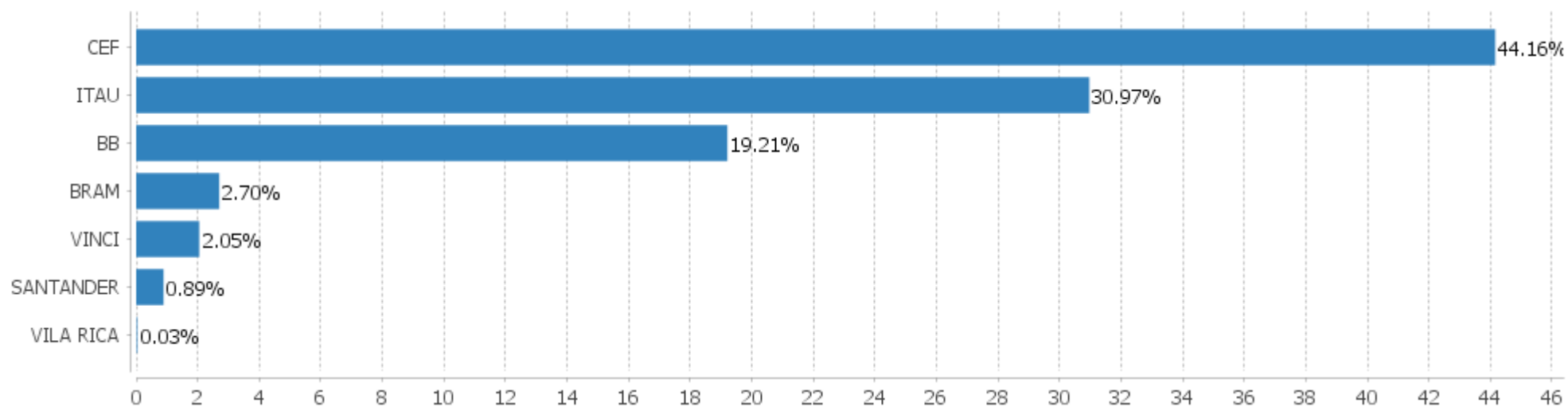


Alocação Por Estratégia



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	0,26												0,26
IPCA + 5,89%	0,71												0,71
p.p. indexador	-0,45												-0,45
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
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	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

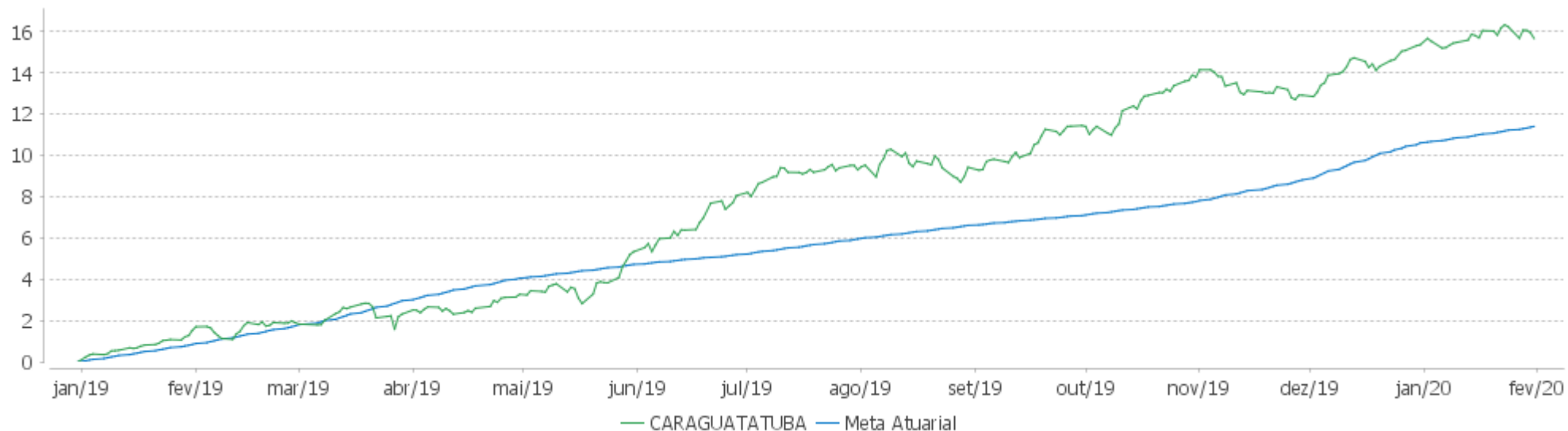
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

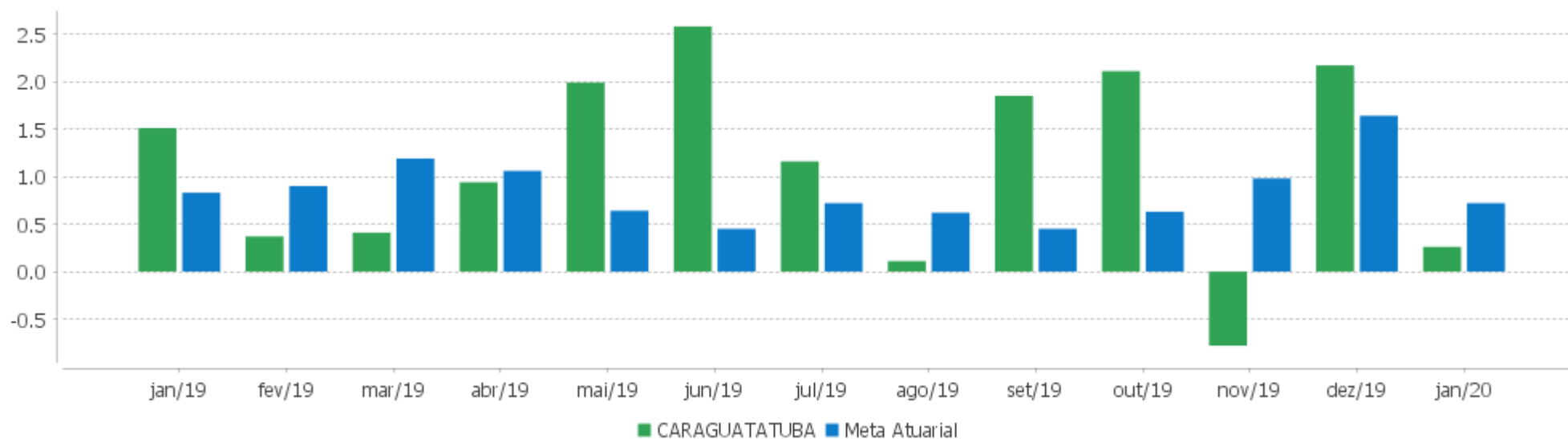
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	53,85	03 meses	1,64	3,36	-1,73	3,17
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	46,15	06 meses	5,81	5,13	0,68	3,47
			12 meses	13,93	10,46	3,47	3,38
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,58	2019-06	Desde 31/12/2018	15,65	11,38	4,27	3,26
Menor rentabilidade da Carteira	-0,78	2019-11					

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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,37 98,58	0,37 98,58	1,05 92,44	2,48 95,16	5,59 96,62	12,17 97,14	22,64 98,06
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,21 54,45	0,21 54,45	-0,59 -52,01	5,76 221,33	19,42 335,75	35,88 286,33	54,84 237,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,37 98,46	0,37 98,46	1,03 91,06	2,44 93,73	5,55 95,93	12,08 96,40	22,61 97,91
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,34 0,13	0,34 0,13	1,04 -0,84	2,66 0,60	9,69 5,50	19,74 11,62	34,32 23,11
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-3,47 -921,66	-3,47 -921,66	58,86 5.181,62	14,72 565,35	4.493,91 77.688,88	1.539,47 12.284,15	185.902,44 805.184,64
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IRF-M 1 p.p.	0,43 -0,02	0,43 -0,02	1,10 -0,10	2,90 -0,14	6,41 -0,20	13,53 -0,50	25,04 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,36 -0,12	5,44 -0,20	17,72 -0,40	34,14 -0,64	53,25 -1,07
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,13 -0,07	2,89 -0,15	6,33 -0,29	13,50 -0,54	24,99 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,84 -0,04	0,84 -0,04	0,96 -0,08	4,33 -0,17	11,12 -0,35	22,99 -0,54	39,91 -1,04
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04 -0,07	-0,04 -0,07	-1,75 -0,21	5,77 -0,31	21,74 -0,59	42,13 -1,28	64,08 -1,90
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,01 -0,02	0,01 -0,02	-1,60 -0,06	5,91 -0,17	21,84 -0,49	41,95 -1,45	63,43 -2,55
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 -0,30	-0,03 -0,30	1,62 1,86	3,33 -2,31	7,50 -10,62	17,30 -17,48	25,73 -28,59
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,04	0,40 -0,04	1,08 -0,11	2,80 -0,25	6,12 -0,49	13,11 -0,92	24,45 -1,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,08 -0,04	1,08 -0,04	0,92 -0,07	5,12 -0,15	13,23 -0,34	27,17 -0,54	46,21 -1,16
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,02	0,24 -0,02	-0,29 -0,05	5,52 -0,13	17,77 -0,34	33,68 -1,10	52,36 -1,96
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,06	0,20 -0,06	1,55 1,79	3,91 -1,73	9,21 -8,90	20,11 -14,67	34,75 -19,57
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	0,82	0,82	0,91	4,67	14,10	25,30	39,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	-0,97	2,62	9,91	17,17	27,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,46 -0,08	0,46 -0,08	1,57 -0,19	4,44 -0,31	10,30 -0,72	20,93 -1,51	35,71 -2,96
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,85 -0,02	0,85 -0,02	0,98 -0,06	4,38 -0,12	11,22 -0,24	23,04 -0,50	39,99 -0,96
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,05 0,01	0,05 0,01	-1,45 0,09	6,13 0,06	22,08 -0,25	42,79 -0,62	64,47 -1,51
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-1,29 0,34	-1,29 0,34	4,28 -1,82	11,26 -0,48	18,91 2,11	40,76 6,78	94,56 18,65
FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	1,95 3,58	1,95 3,58	16,92 10,82	24,18 12,44	35,42 18,62	67,70 33,72	124,71 48,80
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,19	-0,19	9,98	18,27	31,46	59,14	
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,53 3,11	1,53 3,11	10,76 -0,03	17,94 0,79	28,52 1,51	51,11 0,35	95,52 4,37
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,68 2,31	0,68 2,31	10,42 4,32	16,16 4,43	23,73 6,93	43,87 9,90	86,45 10,54
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-0,42 1,21	-0,42 1,21	7,87 1,77	11,61 -0,12	18,23 1,43	36,18 2,20	68,85 -7,06
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	1,61 3,24	1,61 3,24	15,57 9,47	21,71 9,97	35,76 18,96	71,51 37,54	134,27 58,36
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-1,09 0,54	-1,09 0,54	7,44 1,34	14,37 2,63	19,95 3,14	39,21 5,23	81,48 5,57
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32
IMA-C TOTAL	2,54	2,54	1,76	6,14	20,05	38,88	56,63
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	0,50	0,70	4,08	11,07	22,22	37,86
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
Renda Variável							
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06
Índice Consumo - ICON			15,32	21,23	43,29	43,57	87,57
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,82	15,10	14,63
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64
IPCA + 5,5%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33
INPC + 4%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

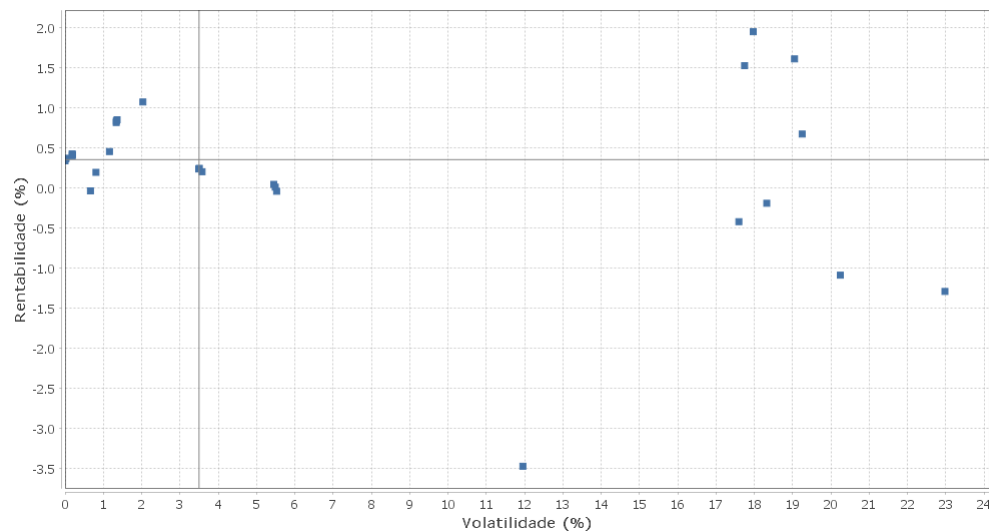
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
09/01/2020	BB PREV IMA-B5+	252.700,66	0,00	74.741,46231100	3,3809970020
09/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	25.000,00	6.839,73378300	3,6551130000
09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	237,00	0,00	106,79673300	2,2191690000
10/01/2020	BB PREV IMA-B5+	316.501,61	0,00	93.449,23799000	3,3868827270
16/01/2020	BB PREV IMA-B5+	9.232,22	0,00	2.729,91054500	3,3818763830
16/01/2020	BB PREV IMA-B5+	1.157,32	0,00	342,21239000	3,3818763830
16/01/2020	BB PREV IMA-B5+	1.655,70	0,00	489,58028300	3,3818763830
16/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	22.000,00	6.013,93101100	3,6581730000
16/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	106,17	0,00	47,82973200	2,2197490000
20/01/2020	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	948.680,90	0,00	88.217,03707000	10,7539420000
21/01/2020	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.238.188,75	0,00	208.170,76209000	10,7516960000
22/01/2020	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	294.349,56	0,00	27.274,78739000	10,7920020000
22/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	240,00	0,00	107,75987800	2,2271740000
28/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	105.114,76	0,00	47.107,82861600	2,2313650000
30/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	132.884,30	36.266,17313900	3,6641390000
30/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	11.714,24	0,00	5.249,47255300	2,2315080000
30/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	1.996.962,45	894.893,70011600	2,2315080000
31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	1.264,23	0,00	566,56765400	2,2313840000
31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	11.714,24	5.249,76406000	2,2313840000
31/01/2020	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	11.714,24	0,00	4.385,80352600	2,6709450000

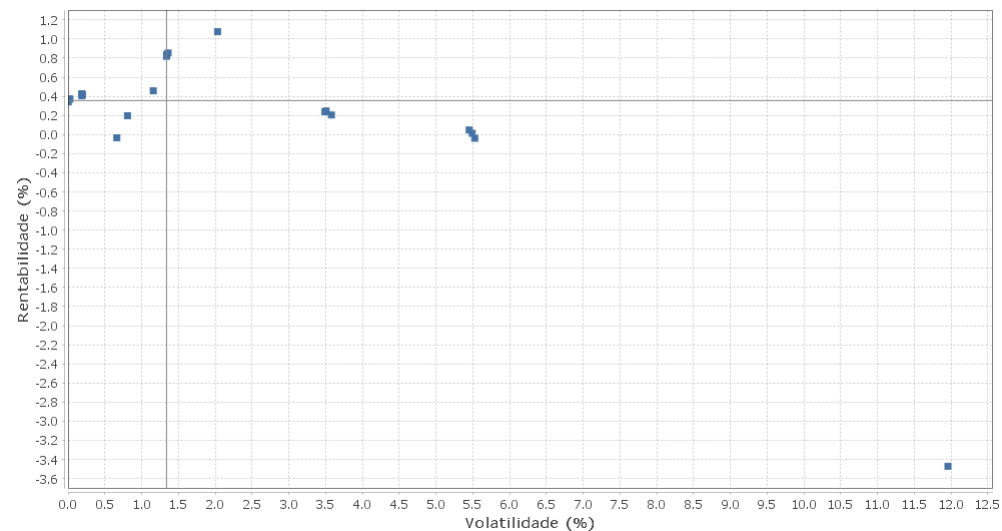
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

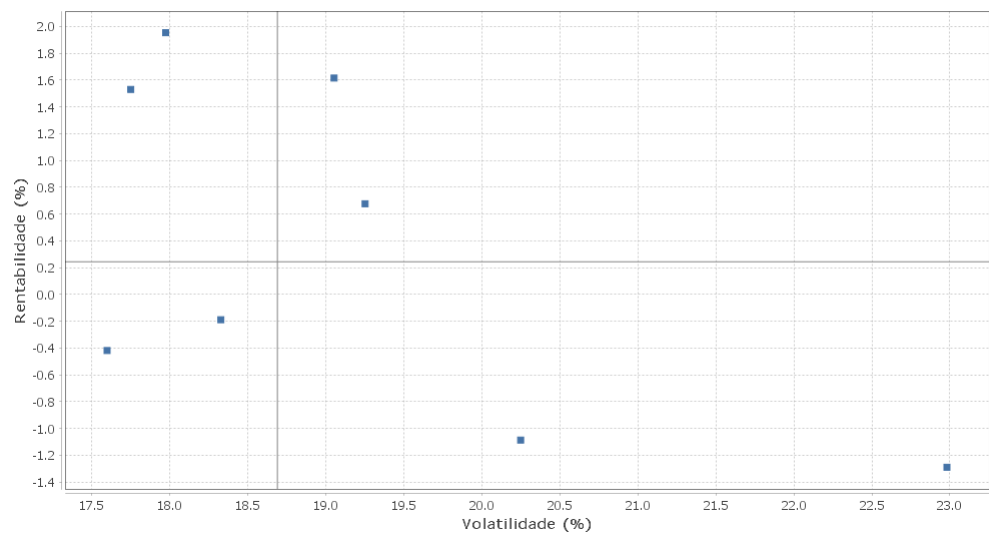
CARAGUATATUBA - No Mês



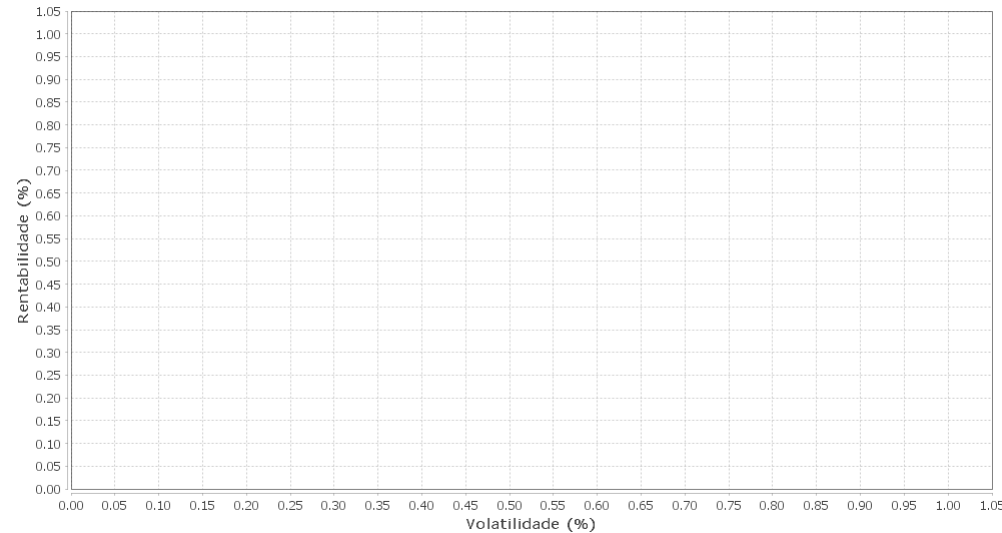
Renda Fixa - No Mês



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 INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	0,34	41.856.362,79	8,62
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,37	7.298.208,64	1,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,37	3.291.286,95	0,68
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,43	24.655.609,12	5,08
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,40	4.306.124,34	0,89
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	25.893.285,26	5,33
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,66	0,07	-0,03	51.742.480,00	10,66
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,81	0,09	0,20	1.334.656,63	0,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,16	0,14	0,46	56.881.589,03	11,72
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,18	0,82	16.910.873,35	3,48
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,18	0,84	6.676.886,00	1,38
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,18	0,85	15.641.049,08	3,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,03	0,26	1,08	13.248.355,40	2,73
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	0,37	0,24	16.052.465,30	3,31
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	0,37	0,25	14.078.678,31	2,90
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	3,58	0,38	0,21	40.737.108,36	8,39
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	5,45	0,57	0,05	23.928.885,08	4,93
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,49	0,57	0,01	4.290.760,62	0,88
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,53	0,57	-0,04	51.557.135,97	10,62
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	11,96	1,08	-3,47	128.316,56	0,03
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	17,60	1,80	-0,42	1.728.224,08	0,36
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	17,75	1,91	1,53	2.006.007,86	0,41
FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	17,97	1,95	1,95	7.943.590,01	1,64
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	18,33	1,89	-0,19	6.636.738,24	1,37
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	19,05	2,05	1,61	6.964.465,80	1,43
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	19,25	2,03	0,68	8.847.137,74	1,82
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	20,25	2,05	-1,09	24.725.243,45	5,09
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	2,32	-1,29	6.156.826,81	1,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de janeiro de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso I, Alínea A (5,09% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos, e
- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso II, Alínea A (8,30% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos,