



**LDB**  
EMPRESAS

**CARAGUATATUBA**  
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 07.05.2020.

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

83,02%

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	2,05	0,63	1,49	15.740.024,06	3,27	5.100.791.923,15	0,31
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,25	0,33	0,76	12.730.272,34	2,64	180.665.290,82	7,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,89	0,43	0,68	16.122.233,54	3,35	385.487.147,46	4,18
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,35	0,77	10.973.160,62	2,28	7.492.585.716,79	0,15
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	-0,80	-0,80	14.880.002,63	3,09	6.284.654.664,10	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,44	0,69	43.898.535,93	9,12	6.609.422.706,56	0,66
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,25	0,30	0,71	0,00	0,00	171.482.770,27	0,00
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,26	0,30	0,35	24.294.434,84	5,05	2.259.425.476,17	1,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	4,90	0,00	0,00	4.319.072,92	0,90	1.413.979.781,38	0,31
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	7,28	0,30	0,32	4.303.809,48	0,89	103.032.264,06	4,18
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,29	0,29	0,25	53.162.804,49	11,04	2.293.876.669,47	2,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	2,93	0,78	1,86	13.351.418,05	2,77	2.655.596.398,85	0,50
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,51	0,60	1,06	15.157.858,11	3,15	8.419.154.798,69	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	2,09	0,63	1,48	4.773.186,15	0,99	15.973.064.296,15	0,03
BB	BB	BB PREV RF VII	1,19	0,41	0,61	1.305.059,91	0,27	676.748.275,25	0,19
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,44	0,62	1,44	19.668.158,13	4,09	10.626.779.468,55	0,19
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,80	0,25	0,21	50.480.680,00	10,48	994.853.758,21	5,07
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,59</b>	<b>0,24</b>	<b>0,55</b>	<b>305.160.711,20</b>	<b>63,38</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	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,07	0,27	0,64	4.663.279,57	0,97	1.077.211.503,51	0,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,36	0,70	0,91	41.023.479,49	8,52	354.676.028,50	11,57
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,27	0,65	3.022.550,19	0,63	5.421.482.050,58	0,06
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,69	0,26	0,60	45.719.259,43	9,50	5.092.614.949,01	0,90
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>1,91</b>	<b>0,45</b>	<b>0,75</b>	<b>94.428.568,68</b>	<b>19,61</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
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	254,67	-1,91	-5,32	125.865,16	0,03	4.947.205,43	2,54
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>254,67</b>	<b>-1,91</b>	<b>-5,32</b>	<b>125.865,16</b>	<b>0,03</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,45</b>	<b>0,29</b>	<b>0,60</b>	<b>399.715.145,04</b>	<b>83,02</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**16,98%**

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	19,01	-7,77	-8,77	22.805.269,38	4,74	843.490.895,06	2,70
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>19,01</b>	<b>-7,77</b>	<b>-8,77</b>	<b>22.805.269,38</b>	<b>4,74</b>		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,11	-11,06	-12,20	5.476.034,53	1,14	852.904.449,09	0,64
BB	BB	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	17,97	-8,73	-9,11	1.577.424,66	0,33	1.122.348.597,47	0,14
BRAM	BEM	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	18,32	-7,91	-6,42	6.413.626,16	1,33	2.341.977.575,47	0,27
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	18,20	-7,78	-7,15	8.159.193,08	1,69	830.830.920,01	0,98
VINCI	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	18,59	-6,80	-4,98	7.403.737,55	1,54	418.083.889,57	1,77
VINCI	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	17,49	-6,37	-4,94	12.807.648,87	2,66	909.648.393,83	1,41
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	18,52	-7,37	-7,37	11.115.085,19	2,31	1.592.945.431,21	0,70
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,26	-9,79	-9,96	5.986.834,81	1,24	4.106.559.997,95	0,15
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>17,90</b>	<b>-8,06</b>	<b>-7,48</b>	<b>58.939.584,85</b>	<b>12,24</b>		

**Renda Variável e Investimentos Estruturados**

**18,04    -7,88    -7,91    81.744.854,23    16,98**

**Total**

**481.459.999,27    100,00**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	305.160.711,20	63,38	10,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	94.428.568,68	19,61	1,00	10,00	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	125.865,16	0,03	0,01	0,50	1,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>399.715.145,04</b>	<b>83,02</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	22.805.269,38	4,74	10,00	15,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	58.939.584,85	12,24	10,00	15,00	20,00	20,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>81.744.854,23</b>	<b>16,98</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 b % do CDI	0,24 82,06	0,55 82,42	1,84 175,89	4,76 199,17	11,92 213,78	890.874,46	1.914.785,29
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,45 154,46	0,75 111,56	1,77 168,99	3,94 164,58	10,75 192,85	421.321,70	693.328,92
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-1,91 -650,41	-5,32 -791,61	-3,63 -346,44	15,30 639,69	1.319,65 23.674,53	-2.451,40	-7.065,69
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,77 0,66	-8,77 1,15	-1,87 1,88	5,06 2,06	13,05 4,06	-1.919.974,07	-2.191.638,66
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,06 0,37	-7,48 2,44	1,03 4,78	7,03 4,02	20,94 11,95	-5.343.405,69	-5.091.317,66
						-5.953.635,00	-4.681.907,80

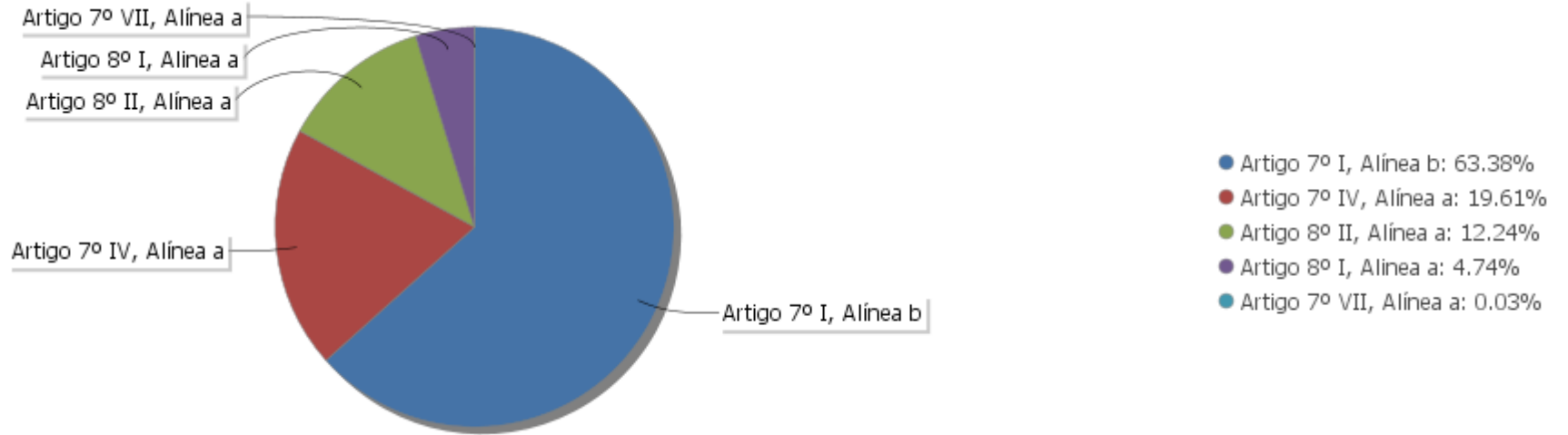
Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	392.235.087,78	81,47	392.235.087,78	81,47
de 31 a 364 dias	87.793.986,42	18,23	480.029.074,20	99,70
acima de 365 dias	1.430.925,07	0,30	481.459.999,27	100,00

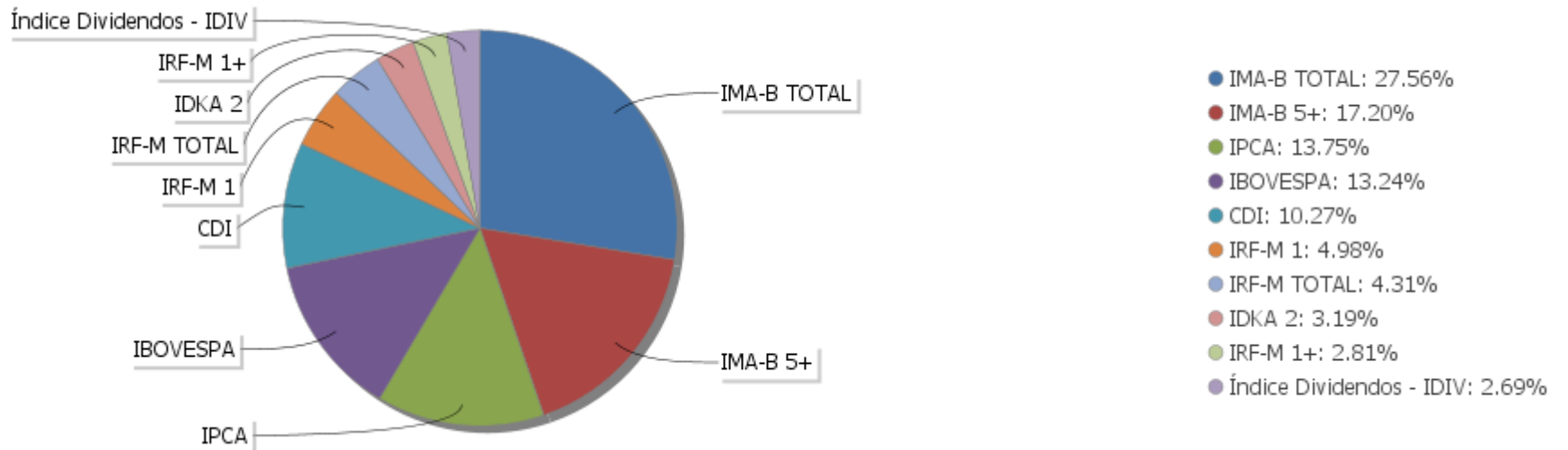


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



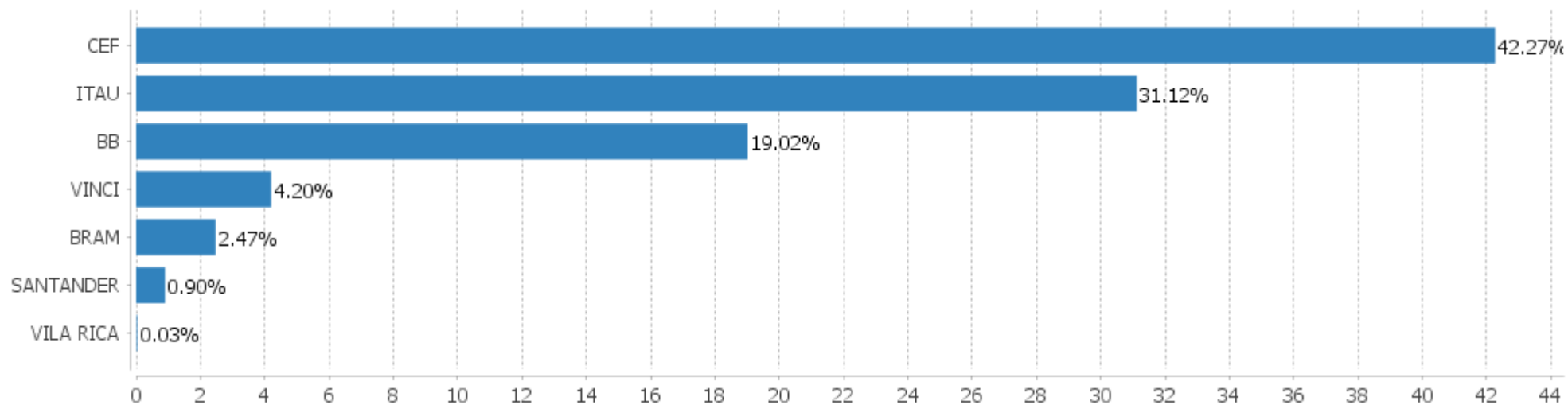
Alocação Por Estratégia





## 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	-1,20											-0,94
IPCA + 5,89%	0,71	0,66											1,38
p.p. indexador	-0,45	-1,86											-2,32
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

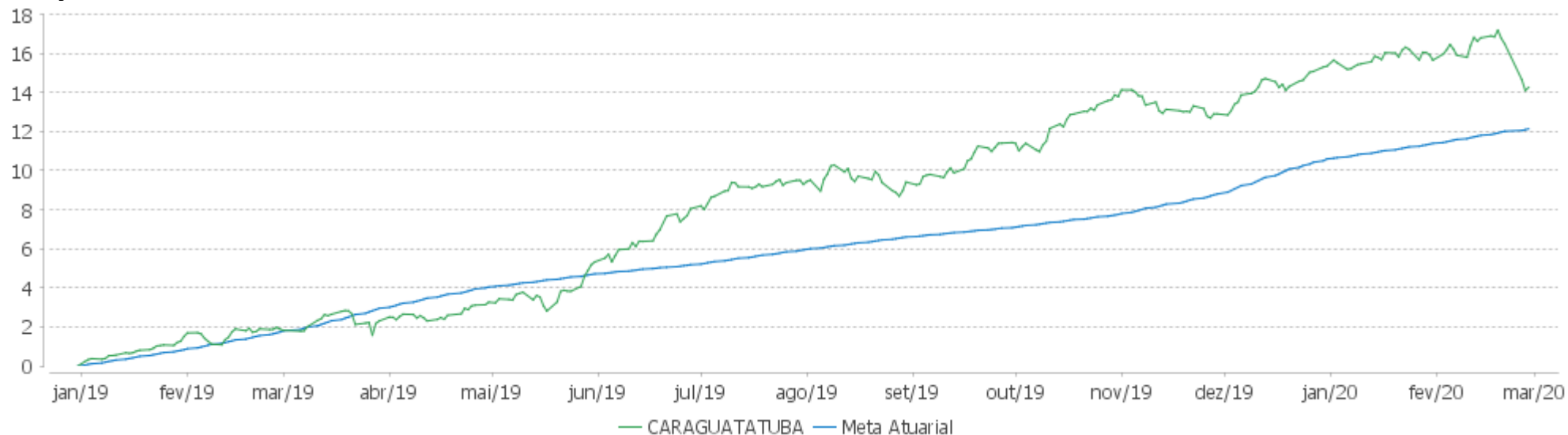
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

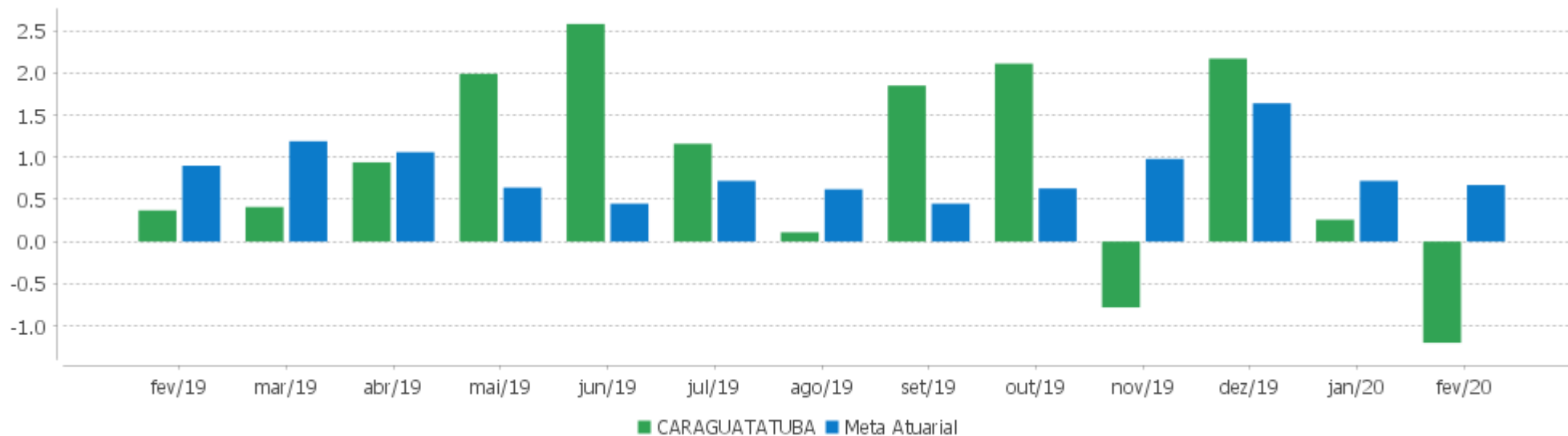
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	50,00	03 meses	1,20	3,04	-1,84	4,81
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	50,00	06 meses	4,43	5,17	-0,75	4,05
			12 meses	12,14	10,20	1,94	3,88
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,58	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,20	2020-02	Desde 31/12/2018	14,26	12,11	2,14	3,65

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
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 -0,05	0,76 -0,06	1,16 -0,09	2,76 -0,11	6,25 -0,27	13,32 -0,53	24,22 -0,84
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
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	24,21 -0,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,48 -0,06	2,09 -0,07	4,79 -0,12	11,51 -0,35	22,34 -0,65	37,98 -1,08
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,29 -0,03	0,25 -0,10	2,82 -0,15	6,92 -0,32	21,46 -0,58	41,77 -1,29	56,76 -1,73
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,30 -0,01	0,32 -0,04	2,90 -0,06	7,08 -0,16	21,61 -0,44	41,66 -1,41	56,11 -2,38
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
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 -0,05	0,74 -0,08	1,12 -0,12	2,62 -0,25	6,02 -0,50	12,91 -0,94	23,59 -1,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,78 -0,02	1,86 -0,06	2,58 -0,08	5,89 -0,11	13,88 -0,34	26,38 -0,68	43,90 -1,22
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,01	0,68 -0,04	2,68 -0,05	6,42 -0,12	17,71 -0,29	33,57 -1,08	47,41 -1,85
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
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 IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,60 -0,08	1,06 -0,16	2,17 -0,27	4,96 -0,41	10,35 -0,84	20,98 -1,54	34,79 -2,98
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,70 -0,01	2,69 -0,05	6,44 -0,10	17,76 -0,24	33,99 -0,66	48,16 -1,11
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,49 -0,04	2,11 -0,06	4,80 -0,11	11,62 -0,24	22,46 -0,52	38,10 -0,96
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,30 -0,02	0,35 -0,01	3,08 0,11	7,29 0,06	21,88 -0,16	42,45 -0,62	57,12 -1,37
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	0,43	0,67	2,66	6,41	17,66	33,92	48,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,04	-0,07	-0,13	-0,34	-0,73	-1,08
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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,27 91,14	0,64 95,31	0,97 92,66	2,25 93,95	5,36 96,16	11,97 96,96	21,91 97,83
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,70 238,11	0,91 134,91	2,97 283,19	6,97 291,25	19,63 352,16	36,12 292,67	50,13 223,87
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,27 93,24	0,65 96,16	1,00 95,34	2,22 92,84	5,33 95,61	11,90 96,39	21,87 97,66
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,26 0,01	0,60 0,14	0,95 -0,67	2,60 0,40	9,60 5,60	19,17 11,12	31,31 20,19
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-11,06 -2,63	-12,20 -2,28	-5,89 -2,14	-3,70 -6,71	6,90 -2,09	22,97 0,92	65,96 9,69
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-6,85 1,58	-5,66 4,26	3,25 7,01	6,30 3,29	19,62 10,64	44,17 22,13	83,52 27,25
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST Var. IBOVESPA p.p.	-6,80 1,63	-4,98 4,94	6,63 10,39	13,90 10,89	29,18 20,20	54,24 32,19	100,93 44,66
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-9,79	-9,96	-2,64	5,05	20,11	42,38	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST 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
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-7,78 0,65	-7,15 2,77	0,53 4,28	6,88 3,88	15,97 6,98	31,15 9,10	66,14 9,87
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-8,73 -0,30	-9,11 0,81	-1,64 2,12	1,17 -1,84	10,05 1,07	23,89 1,84	46,59 -9,68
BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	-7,91 0,52	-6,42 3,50	3,34 7,09	10,51 7,51	27,29 18,31	57,75 35,71	106,37 50,11
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-7,77 0,66	-8,77 1,15	-1,87 1,88	4,96 1,96	12,66 3,68	28,85 6,81	61,57 5,30
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	-6,70	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	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	63.657,75	0,00	23.752,31570800	2,6800650000
05/02/2020	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.460,80	0,00	134,21168733	10,8842980000
10/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	44.000,00	11.995,32718100	3,6680950000
10/02/2020	BB PREV IMA-B5+	1.735,88	0,00	503,24080700	3,4494023000
10/02/2020	BB PREV IMA-B5+	248.380,69	0,00	72.006,87782900	3,4494023000
11/02/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,00	12.000.000,00	5.380.712,29752600	2,2301880000
12/02/2020	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	12.000.000,00	0,00	5.401.035,91868920	2,2217960000
12/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.806,12	0,00	102,59002145	17,6052210000
13/02/2020	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	22.961,94	0,00	8.420,39293800	2,7269440000
13/02/2020	BB PREV IMA-B5+	9.232,22	0,00	2.659,66998900	3,4711900490
14/02/2020	BB PREV IMA-B5+	1.655,70	0,00	472,95386700	3,5007642700
17/02/2020	BB PREV RF VII	0,00	35.069,60	20.034,72449800	1,7504408410
18/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	106,17	0,00	47,26927200	2,2460680000
18/02/2020	BB PREV IMA-B5+	35.069,60	0,00	10.063,74393500	3,4847468520
19/02/2020	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	1.389.392,28	0,00	506.032,72003700	2,7456570000
19/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	13.000,00	3.540,11795100	3,6721940000
21/02/2020	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	12.000.000,00	0,00	423.571,00643754	28,3305510000
21/02/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00	12.000.000,00	365.209,79811628	32,8578260000
21/02/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	2.653.224,82	0,00	1.842.040,09655800	1,4403730000
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	30.000.000,00	0,00	8.485.734,77270200	3,5353450000
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	105.114,76	0,00	46.807,29147100	2,2456920000
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,00	30.000.000,00	13.377.765,35443700	2,2425270000
21/02/2020	BB PREV IMA-B5+	1.735,88	0,00	502,00121000	3,4579199520
21/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	15.000.000,00	5.655.825,39867600	2,6521327910
21/02/2020	BB PREV IMAB TPB	15.000.000,00	0,00	2.397.686,71799200	6,2560299840
21/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3.186.100,39	0,00	180.798,82701235	17,6223510000
21/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	2.653.224,84	847,49818239	3.130,6554930000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	2.051.792,95	914.008,57332100	2,2448290000

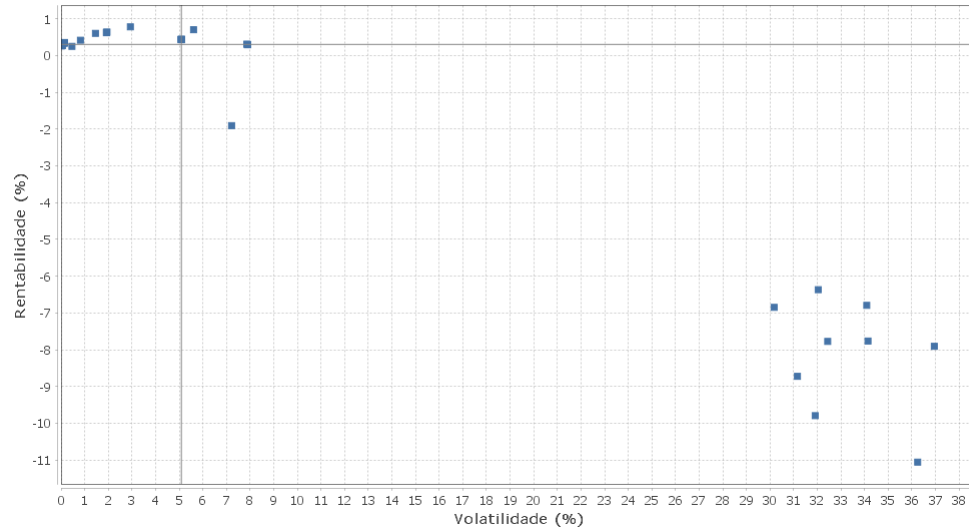
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
27/02/2020	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	13.725,88	0,00	5.124,69095100	2,6783820000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	220.628,79	60.047,18445500	3,6742570000
27/02/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	1.163.147,04	46.123,64536800	25,2180208000
27/02/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	3.155.925,88	125.145,66091563	25,2180208000
27/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	565.766,56	0,00	32.096,24222579	17,6271900000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	1.264,23	0,00	563,00701400	2,2454960000
28/02/2020	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	4.317.956,90	0,00	158.558,93984000	27,2325036000
28/02/2020	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	1.116,02	0,00	40,98117600	27,2325036000

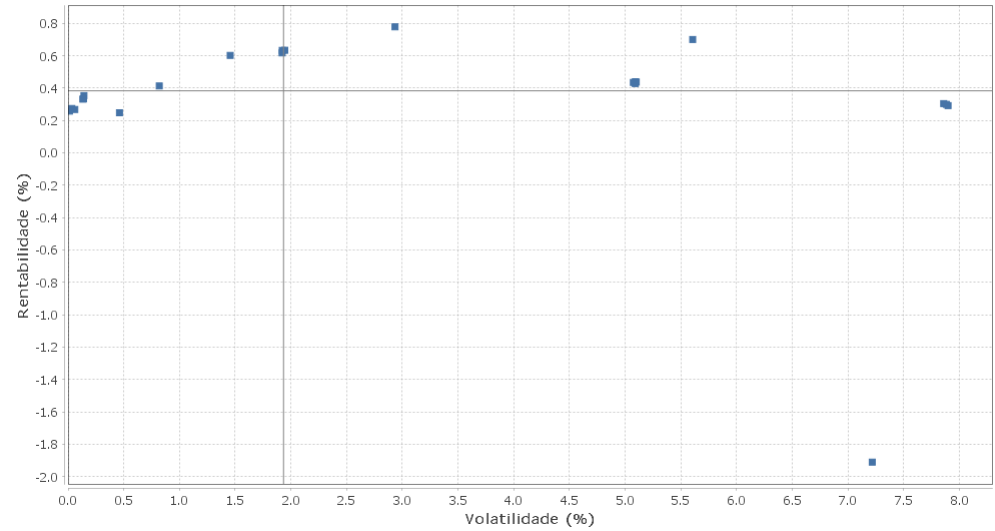
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

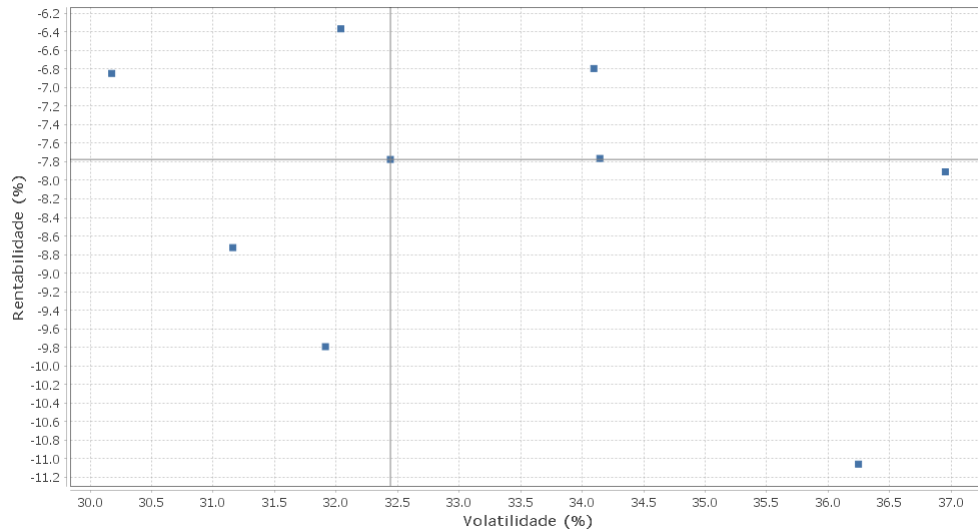
CARAGUATATUBA - No Mês



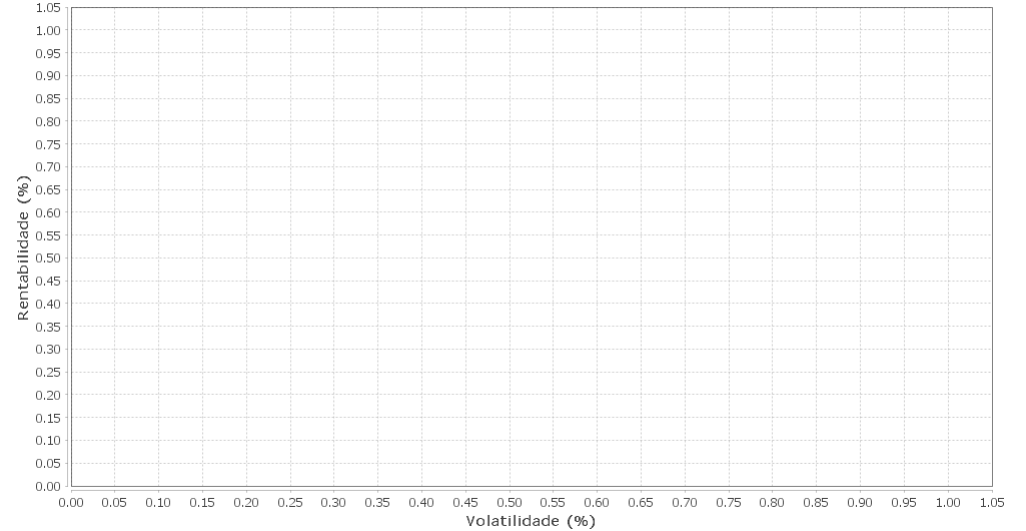
Renda Fixa - No Mês



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	0,01	0,02	0,26	45.719.259,43	9,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,27	3.022.550,19	0,63
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,02	0,27	4.663.279,57	0,97
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 7º I, Alínea b	0,13	0,03	0,33	12.730.272,34	2,64
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,33	0,00	0,00
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,35	10.973.160,62	2,28
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,06	0,25	50.480.680,00	10,48
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,82	0,11	0,41	1.305.059,91	0,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,46	0,18	0,60	15.157.858,11	3,15
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,62	19.668.158,13	4,09
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,63	4.773.186,15	0,99
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	0,24	0,63	15.740.024,06	3,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	0,35	0,78	13.351.418,05	2,77
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,07	0,55	0,43	16.122.233,54	3,35
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,43	4.319.072,92	0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,44	43.898.535,93	9,12
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	5,10	0,55	0,44	14.880.002,63	3,09
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,61	0,62	0,70	41.023.479,49	8,52
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	7,22	0,64	-1,91	125.865,16	0,03
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,86	0,83	0,30	4.303.809,48	0,89
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	7,88	0,83	0,30	24.294.434,84	5,05
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,90	0,83	0,29	53.162.804,49	11,04
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	30,18	2,73	-6,85	11.115.085,19	2,31
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	31,16	2,72	-8,73	1.577.424,66	0,33
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	31,91	2,73	-9,79	5.986.834,81	1,24
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	2,95	-6,37	12.807.648,87	2,66
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	32,44	2,91	-7,78	8.159.193,08	1,69
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	Artigo 8º II, Alínea a	34,09	3,14	-6,80	7.403.737,55	1,54
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	34,14	3,09	-7,77	22.805.269,38	4,74
BRANCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	36,25	3,10	-11,06	5.476.034,53	1,14

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	36,95	3,37	-7,91	6.413.626,16	1,33

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

No respectivo mês de fevereiro de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso I, Alínea A (4,74% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.