



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
MARÇO 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

86,67%

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	5,03	-0,11	1,38	15.722.587,03	3,56	4.885.428.546,31	0,32
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,44	0,57	1,33	8.716.902,10	1,97	200.383.301,92	4,35
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11,04	-6,95	-6,32	15.002.204,70	3,40	346.254.084,73	4,33
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,45	0,60	1,38	11.038.737,15	2,50	6.969.533.398,64	0,16
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-7,73	13.840.934,57	3,13	5.743.378.118,49	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	40.780.803,71	9,24	5.890.819.394,91	0,69
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	16,80	-10,89	-10,58	22.610.876,03	5,12	1.940.264.057,52	1,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	11,14	-7,17	-7,17	4.009.559,60	0,91	1.314.979.649,02	0,30
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	16,77	-10,98	-10,70	3.831.090,52	0,87	85.674.508,84	4,47
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	16,90	-10,91	-10,68	47.384.644,05	10,73	1.935.373.241,51	2,45
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	7,48	-0,45	1,41	13.291.874,75	3,01	2.758.205.111,21	0,48
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,65	-1,45	-0,41	14.937.509,64	3,38	8.199.299.170,30	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	5,02	-0,11	1,36	4.760.475,93	1,08	15.907.113.181,36	0,03
BB	BB	BB PREV RF VII	2,22	-1,34	-0,74	1.287.555,37	0,29	667.671.168,60	0,19
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	5,32	-0,13	1,31	19.642.456,72	4,45	11.020.077.699,37	0,18
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,13	-1,13	-0,92	49.908.920,00	11,30	983.585.151,09	5,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,10	-5,01	-4,48	286.767.131,87	64,95		

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	0,11	0,25	0,89	4.797.518,95	1,09	936.558.105,78	0,51
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	12,89	-6,12	-5,27	38.514.435,17	8,72	389.255.098,96	9,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,14	0,79	2.803.514,70	0,63	5.503.080.783,31	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,32	0,53	1,13	49.672.363,02	11,25	5.019.962.419,71	0,99
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,27	-2,46	-1,73	95.787.831,84	21,69		
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	182,26	13,01	7,01	142.243,07	0,03	5.043.559,07	2,82
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			182,26	13,01	7,01	142.243,07	0,03		
Renda Fixa			7,41	-4,40	-3,83	382.697.206,78	86,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,33%

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	40,98	-30,82	-36,89	15.775.893,76	3,57	598.696.495,88	2,64
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			40,98	-30,82	-36,89	15.775.893,76	3,57		

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	40,65	-31,54	-39,89	3.749.010,72	0,85	557.582.118,41	0,67
BB	BB	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	34,90	-29,38	-35,81	1.114.026,39	0,25	751.642.834,81	0,15
BRAM	BEM	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	40,05	-31,64	-36,03	4.384.182,52	0,99	1.534.763.661,47	0,29
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	40,38	-31,34	-36,25	7.718.101,03	1,75	577.164.782,79	1,34
VINCI	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	37,74	-31,10	-34,53	5.100.840,43	1,16	375.488.566,24	1,36
VINCI	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	35,44	-27,40	-30,98	9.298.245,50	2,11	668.247.605,13	1,39
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	38,15	-31,06	-36,14	7.663.056,04	1,74	1.171.296.538,03	0,65
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	38,94	-32,44	-39,18	4.044.427,69	0,92	2.717.755.336,40	0,15
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			37,88	-30,49	-35,69	43.071.890,32	9,75		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

38,64 -30,59 -36,08 58.847.784,08 13,33

Total

441.544.990,86 100,00

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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	286.767.131,87	64,95	10,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	95.787.831,84	21,69	1,00	10,00	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	142.243,07	0,03	0,01	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	382.697.206,78	86,67				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	15.775.893,76	3,57	10,00	15,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	43.071.890,32	9,75	10,00	15,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	58.847.784,08	13,33				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

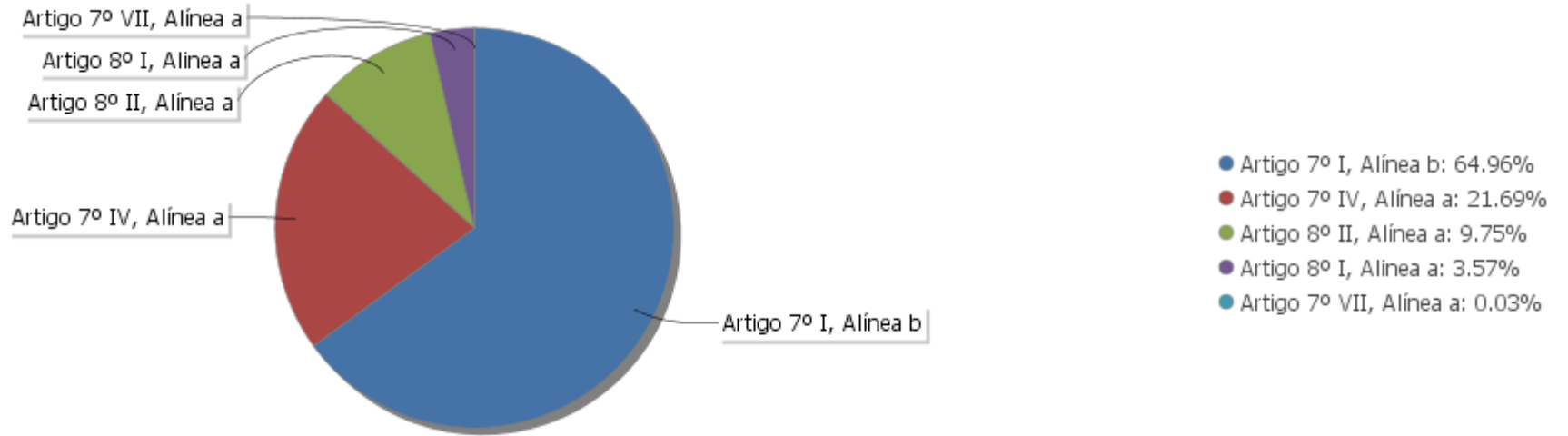
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-5,01 -1.480,42	-4,48 -443,00	-4,48 -443,00	-2,30 -101,74	5,74 105,66	-15.355.788,60	-13.441.003,31
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-2,46 -725,85	-1,73 -170,48	-1,73 -170,48	-0,02 -0,88	7,58 139,39	-2.237.117,20	-1.543.788,28
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	13,01 3.845,58	7,01 692,16	7,01 692,16	33,19 1.465,91	678,75 12.483,84	16.377,91	9.312,22
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,82 -0,92	-36,89 -0,03	-36,89 -0,03	-29,53 0,76	-21,17 2,30	-7.029.375,62	-9.221.014,28
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,49 -0,58	-35,69 1,17	-35,69 1,17	-27,01 3,27	-15,11 8,36	-17.867.694,53	-22.959.012,19
						-42.473.598,04	-47.155.505,84

Análise de Liquidez

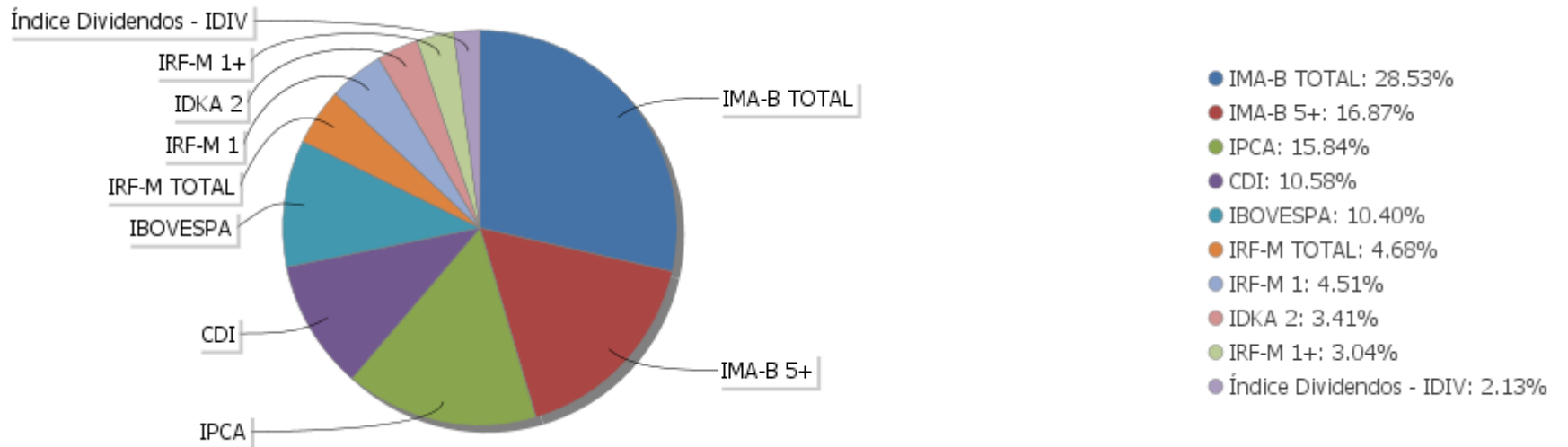
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	364.099.702,76	82,46	364.099.702,76	82,46
de 31 a 364 dias	76.015.489,66	17,22	440.115.192,42	99,68
acima de 365 dias	1.429.798,44	0,32	441.544.990,86	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

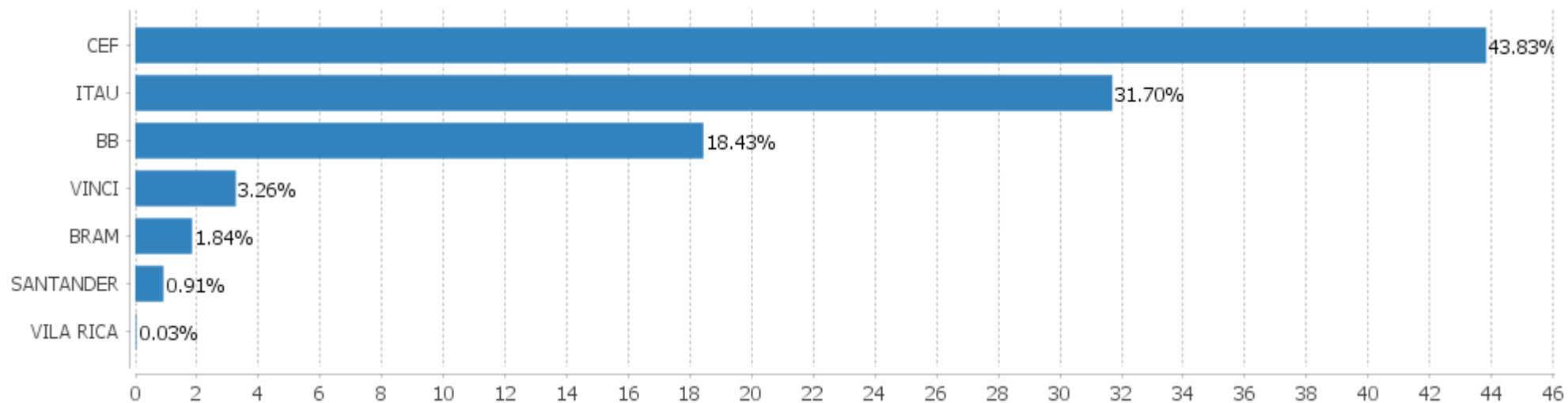


Alocação Por Estratégia



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	-8,82										-9,68
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57										1,96
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40										-11,64
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

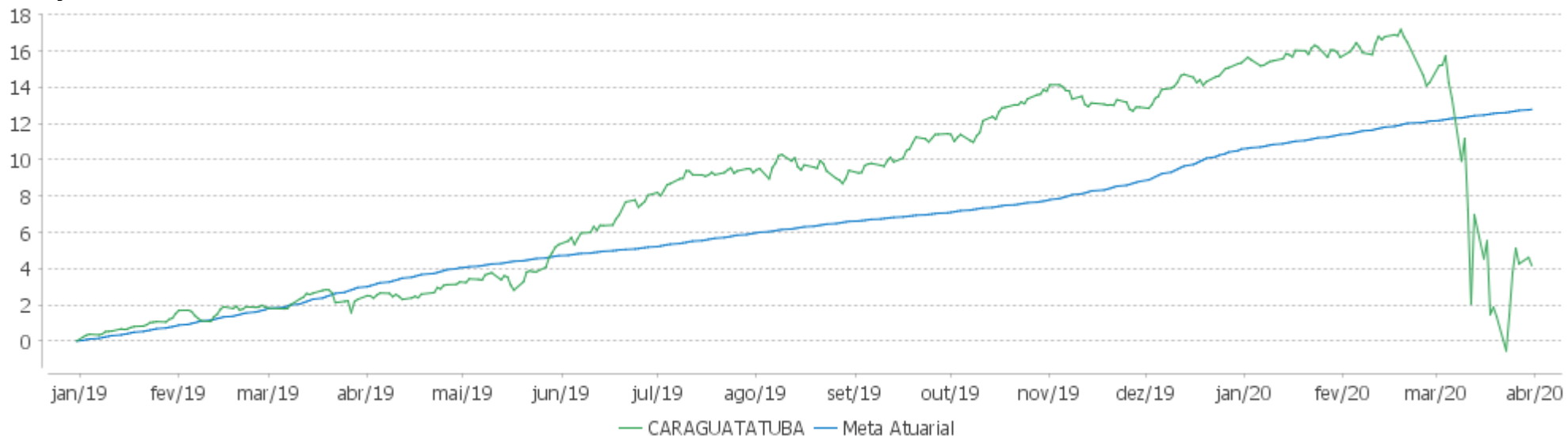
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

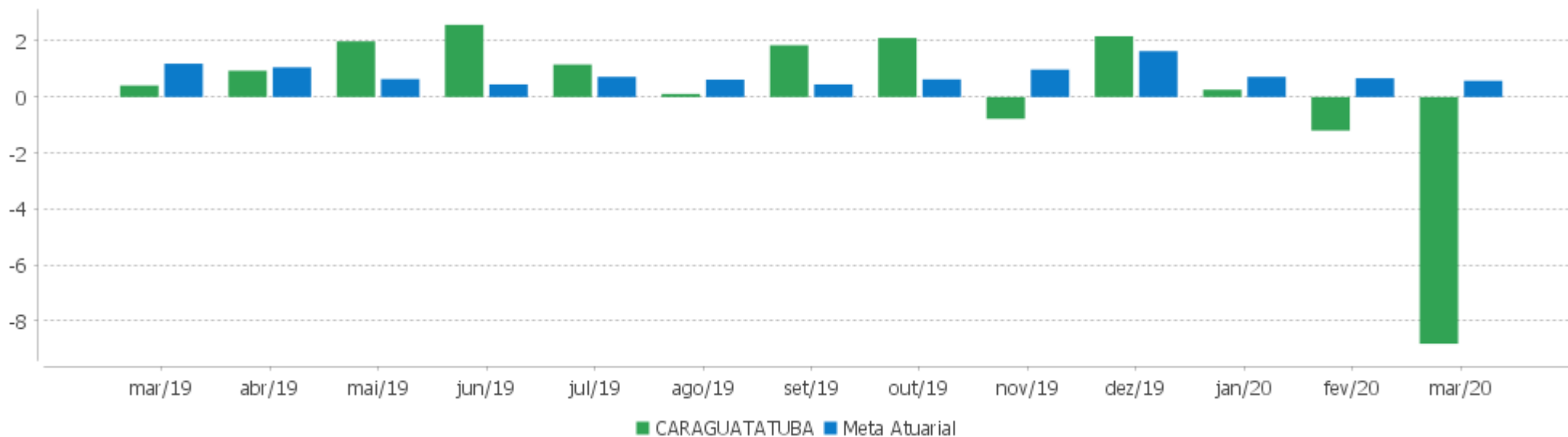
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	46,67	03 meses	-9,68	1,96	-11,64	21,67
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	53,33	06 meses	-6,51	5,31	-11,82	15,40
			12 meses	1,83	9,52	-7,70	11,15
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,58	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03	Desde 31/12/2018	4,17	12,75	-8,58	10,08

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.	0,57 -0,04	1,33 -0,10	1,33 -0,10	2,68 -0,16	6,37 -0,29	13,23 -0,56	23,58 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,01	1,38 -0,06	1,38 -0,06	2,70 -0,13	6,40 -0,26	13,27 -0,53	23,59 -0,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11 -0,01	1,36 -0,06	1,36 -0,06	3,20 -0,11	10,78 -0,31	20,64 -0,61	35,89 -0,97
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,91 0,02	-10,68 -0,07	-10,68 -0,07	-8,13 -0,22	7,75 -0,49	25,87 -1,08	38,51 -1,44
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,98 -0,05	-10,70 -0,08	-10,70 -0,08	-8,08 -0,16	7,82 -0,42	25,68 -1,27	37,82 -2,12
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,13 5,84	-0,92 5,39	-0,92 5,39	1,46 5,11	5,35 -3,79	13,64 -10,47	23,81 -13,61
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,45 0,03	1,41 -0,03	1,41 -0,03	3,50 -0,07	12,70 -0,26	23,91 -0,60	41,11 -1,00
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,95 0,03	-6,32 -0,01	-6,32 -0,01	-3,70 -0,06	8,94 -0,21	23,20 -0,91	35,81 -1,62
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,34 5,63	-0,74 5,57	-0,74 5,57	1,66 5,30	6,93 -2,21	16,97 -7,14	29,44 -7,98
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,13 -0,20	1,31 0,78	1,31 0,78	3,13 0,82	13,46 10,16	23,65 15,62	35,73 24,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,45 -0,24	-0,41 -0,41	-0,41 -0,41	1,98 -0,48	8,03 -1,08	17,44 -1,70	30,97 -2,96
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,98 -0,01	-6,33 -0,02	-6,33 -0,02	-3,73 -0,09	8,93 -0,22	23,52 -0,58	36,42 -1,00
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11 -0,00	1,38 -0,04	1,38 -0,04	3,22 -0,09	10,87 -0,23	20,76 -0,49	35,94 -0,91
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,89 0,04	-10,58 0,04	-10,58 0,04	-7,80 0,11	8,16 -0,07	26,53 -0,41	38,86 -1,08
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,17 -0,19	-6,54 -0,23	-6,54 -0,23	-3,95 -0,31	8,62 -0,52	23,20 -0,91	36,17 -1,25
FIDC ITALIA SENIOR	13,01	7,01	7,01	33,19	678,75	1.720,35	207.762,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	3.845,57	692,16	692,16	1.465,90	12.483,84	14.189,00	964.990,53
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,25	0,89	0,89	2,05	5,14	11,67	20,93
% do CDI	73,86	88,08	88,08	90,35	94,54	96,23	97,21
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-6,12	-5,27	-5,27	-2,62	11,82	26,66	39,54
% do CDI	-1.807,52	-520,27	-520,27	-115,93	217,40	219,90	183,66
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14	0,79	0,79	1,91	4,99	11,48	20,75
% do CDI	42,04	77,94	77,94	84,42	91,77	94,69	96,38
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,53	1,13	1,13	2,34	9,75	18,58	30,29
Var. IPCA p.p.	0,46	0,60	0,60	0,03	6,45	10,56	19,37
BRDESCO F I A SELECTION	-31,54	-39,89	-39,89	-34,30	-26,99	-17,46	19,95
Var. IBOVESPA p.p.	-1,63	-3,03	-3,03	-4,01	-3,52	-3,00	7,59
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-31,06	-34,96	-34,96	-26,97	-16,95	-1,94	28,49
Var. IBOVESPA p.p.	-1,15	1,90	1,90	3,32	6,52	12,52	16,13
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	-31,10	-34,53	-34,53	-22,63	-9,40	3,86	38,10
Var. IBOVESPA p.p.	-1,20	2,33	2,33	7,65	14,07	18,32	25,73
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-32,44	-39,18	-39,18	-31,38	-17,47	-4,42	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	-27,40	-30,98	-30,98	-22,11	-12,36	1,73	28,59
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,87	0,25	0,25	-0,69	-4,59	-3,15	1,41
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-31,34	-36,25	-36,25	-28,08	-19,74	-9,77	16,24
Var. IBOVESPA p.p.	-1,44	0,61	0,61	2,20	3,73	4,69	3,87
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	-29,38	-35,81	-35,81	-29,79	-21,20	-13,42	5,74
Var. IBOVESPA p.p.	0,53	1,05	1,05	0,50	2,27	1,04	-6,63
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	-31,64	-36,03	-36,03	-26,34	-12,50	5,75	42,39
Var. IBOVESPA p.p.	-1,74	0,83	0,83	3,95	10,97	20,21	30,02
BB PREV ACOES GV	-30,82	-36,89	-36,89	-29,53	-21,90	-9,95	13,11
Var. IBOVESPA p.p.	-0,92	-0,03	-0,03	0,76	1,57	4,51	0,75
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

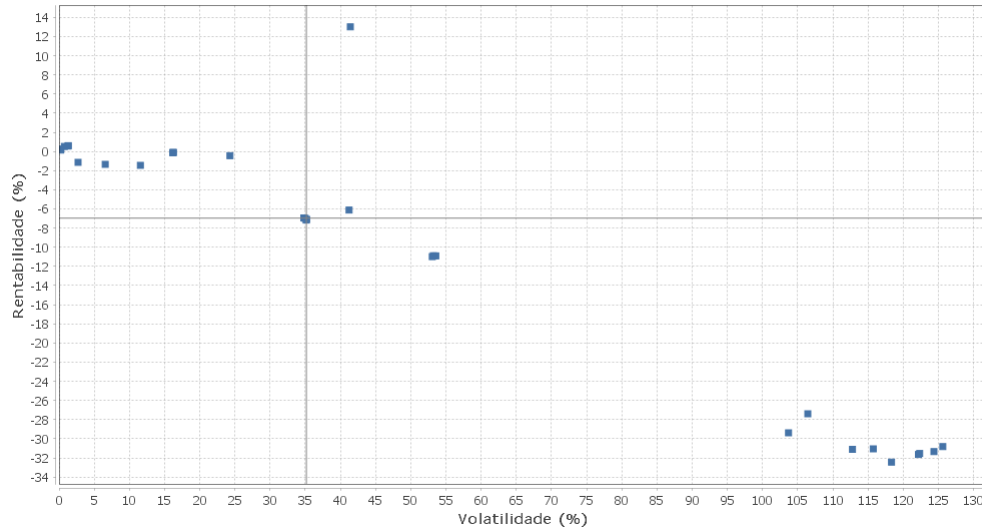
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/03/2020	BB PREV IMA-B5+	474.752,36	0,00	137.818,22089300	3,4447720840
02/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	241,00	0,00	106,82160000	2,2560980000
04/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	7.609,77	3.364,47651900	2,2617990000
05/03/2020	BB PREV IMA-B5+	1.735,88	0,00	507,67409300	3,4192802490
09/03/2020	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	22.961,93	0,00	8.867,63350200	2,5894090000
09/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	63.000,00	17.128,99098300	3,6779750000
10/03/2020	BB PREV IMA-B5+	303.330,29	0,00	91.833,24919400	3,3030551860
12/03/2020	BB PREV IMA-B5+	237.376,18	0,00	82.503,45620500	2,8771664960
12/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.761.250,54	0,00	156.424,76920376	17,6522590000
13/03/2020	BB PREV IMA-B5+	1.655,70	0,00	528,22255900	3,1344742290
16/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	312.807,74	0,00	17.715,38068154	17,6574100000
18/03/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00	2.000.000,00	60.588,57804727	33,0095220000
18/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	7.710,82	436,56370653	17,6625310000
19/03/2020	BB PREV IMA-B5+	9.232,22	0,00	3.116,65677900	2,9622190230
19/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	630.776,85	0,00	35.709,04675028	17,6643430000
19/03/2020	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	2.000.000,00	0,00	1.043.162,40943394	1,9172470000
27/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	107.557,41	0,00	34,26567368	3.138,9258830000
30/03/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00	2.079.595,32	62.920,24668326	33,0512900000
30/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,37216749	3.139,3765270000
30/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	160.291,47	43.559,38289400	3,6798380000
31/03/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00	1.871,20	56,59442560	33,0633270000
31/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.264,23	0,00	0,40262769	3.139,9479570000

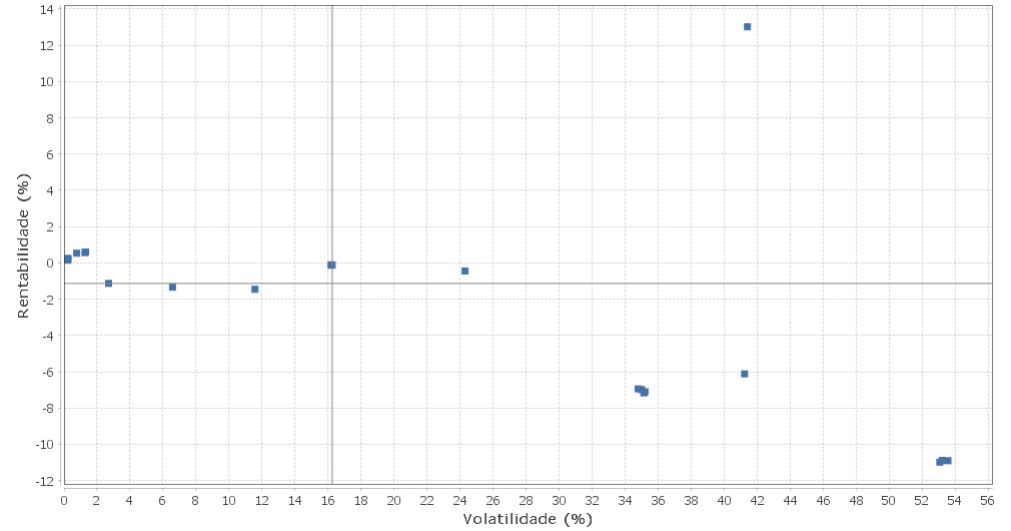
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

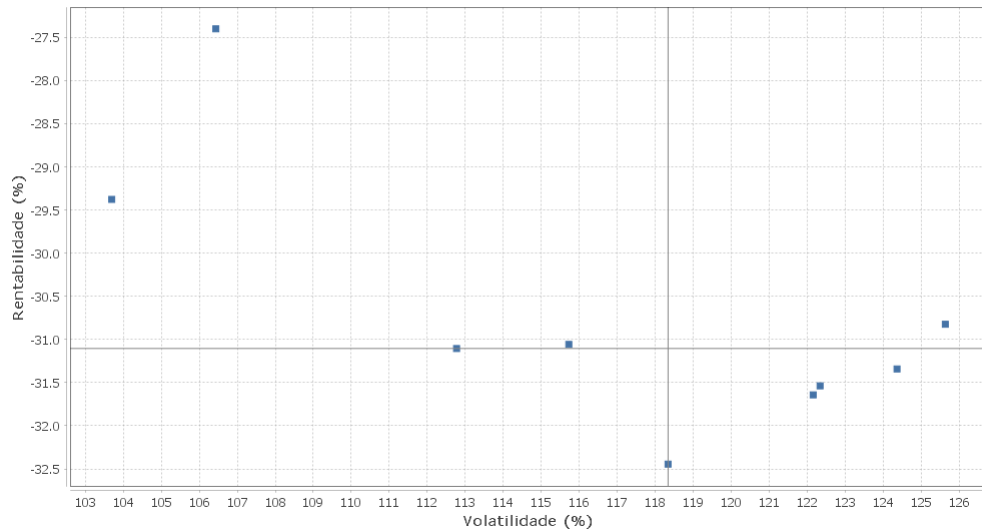
CARAGUATATUBA - No Mês



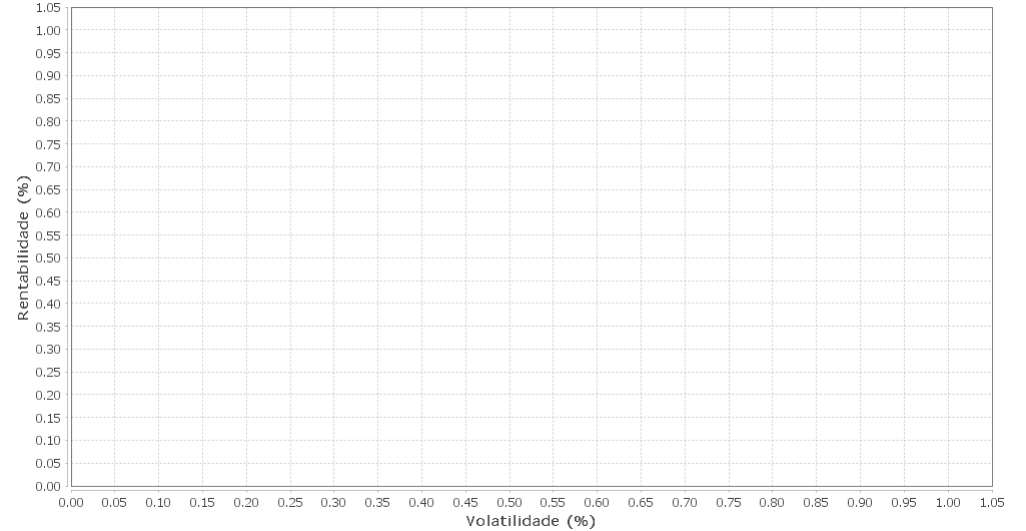
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,03	0,14	2.803.514,70	0,63
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,04	0,25	4.797.518,95	1,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	0,10	0,53	49.672.363,02	11,25
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 7º I, Alínea b	1,26	0,16	0,57	8.716.902,10	1,97
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,60	11.038.737,15	2,50
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	2,70	0,23	-1,13	49.908.920,00	11,30
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	6,57	0,62	-1,34	1.287.555,37	0,29
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,13	-1,45	14.937.509,64	3,38
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	1,67	-0,13	19.642.456,72	4,45
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	16,19	1,67	-0,11	4.760.475,93	1,08
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	16,25	1,68	-0,11	15.722.587,03	3,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	24,29	2,50	-0,45	13.291.874,75	3,01
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	34,78	3,28	-6,95	15.002.204,70	3,40
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	13.840.934,57	3,13
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	35,12	3,30	-7,17	4.009.559,60	0,91
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	40.780.803,71	9,24
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	41,23	3,99	-6,12	38.514.435,17	8,72
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	41,40	4,85	13,01	142.243,07	0,03
ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	53,05	4,97	-10,98	3.831.090,52	0,87
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	53,21	4,99	-10,89	22.610.876,03	5,12
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	53,55	5,02	-10,91	47.384.644,05	10,73
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	103,70	9,16	-29,38	1.114.026,39	0,25
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	Artigo 8º II, Alínea a	106,44	9,57	-27,40	9.298.245,50	2,11
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	Artigo 8º II, Alínea a	112,77	9,99	-31,10	5.100.840,43	1,16
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	115,72	10,30	-31,06	7.663.056,04	1,74
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	118,33	10,48	-32,44	4.044.427,69	0,92
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	122,15	10,93	-31,64	4.384.182,52	0,99
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	122,33	10,95	-31,54	3.749.010,72	0,85
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	124,36	11,18	-31,34	7.718.101,03	1,75
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	125,63	11,34	-30,82	15.775.893,76	3,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de março de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso I, Alínea A (3,57% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.
- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso II, Alínea A (9,75% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.