



CARAGUATATUBA
ABRIL 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 20.07.2020.

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

85,01%

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	5,80	1,07	2,47	15.891.138,23	3,50	4.883.028.533,44	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,52	0,43	1,77	7.325.031,28	1,61	219.155.027,19	3,34
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,21	1,30	-5,10	15.196.959,31	3,35	352.713.830,23	4,31
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,41	1,79	11.712.269,07	2,58	7.168.032.689,23	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,26	1,30	-6,53	14.020.618,16	3,09	5.412.184.320,85	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,33	1,30	-5,25	41.312.230,22	9,11	5.880.207.997,15	0,70
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	18,74	1,92	-8,86	23.044.773,90	5,08	1.959.264.029,83	1,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,31	1,26	-6,00	4.059.949,51	0,89	1.212.263.386,57	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	18,70	1,96	-8,95	3.906.220,07	0,86	85.739.122,81	4,56
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18,85	1,95	-8,95	48.306.399,73	10,65	1.937.305.372,80	2,49
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	8,58	1,44	2,87	13.483.449,75	2,97	2.809.224.859,68	0,48
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	3,97	0,43	0,02	15.001.115,24	3,31	8.182.089.077,85	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,78	1,13	2,50	4.814.192,09	1,06	16.130.391.856,09	0,03
BB	BB	BB PREV RF VII	2,33	0,14	-0,60	1.289.397,44	0,28	668.626.387,30	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,00	1,11	2,43	19.860.741,14	4,38	11.368.843.034,79	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,19	-0,02	-0,94	49.897.240,00	11,00	983.355.098,48	5,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,09	1,13	-3,40	289.121.725,14	63,73		

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	0,24	0,08	0,97	4.977.349,78	1,10	1.079.795.674,75	0,46
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,12	1,53	-3,82	39.103.805,25	8,62	400.972.197,96	9,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,00	0,79	2.617.639,49	0,58	4.876.604.207,95	0,05

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	1,98	0,14	1,28	49.743.532,91	10,97	5.079.848.328,78	0,98
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,13	0,69	-1,05	96.442.327,43	21,26		

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	111,69	-17,57	-11,79	85.237,33	0,02	5.590.948,97	1,52
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			111,69	-17,57	-11,79	85.237,33	0,02		

Renda Fixa			8,37	1,02	-2,85	385.649.289,90	85,01		
-------------------	--	--	-------------	-------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

14,99%

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 AÇÕES GOVERNANÇA FI	42,94	10,99	-29,95	17.509.299,40	3,86	669.048.657,55	2,62
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			42,94	10,99	-29,95	17.509.299,40	3,86		

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	42,40	6,84	-35,78	4.005.559,12	0,88	593.878.228,05	0,67
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	36,80	8,38	-30,43	1.207.362,42	0,27	816.453.425,74	0,15
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	42,22	14,55	-26,73	5.022.134,18	1,11	1.742.936.358,49	0,29
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	42,38	11,57	-28,87	11.679.636,56	2,57	648.464.272,67	1,80
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	39,71	9,76	-28,15	5.598.532,62	1,23	422.453.825,33	1,33
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	37,40	7,24	-25,99	9.971.339,58	2,20	714.263.825,61	1,40
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	40,15	10,96	-29,14	8.503.303,16	1,87	1.265.270.018,30	0,67
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	41,69	11,03	-32,47	4.490.447,34	0,99	2.886.370.474,18	0,16
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,91	10,06	-29,22	50.478.314,98	11,13		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,66	10,31	-29,50	67.987.614,38	14,99		
Total						453.636.904,28	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	289.121.725,14	63,73	10,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	96.442.327,43	21,26	1,00	10,00	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	85.237,33	0,02	0,01	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	385.649.289,90	85,01				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	17.509.299,40	3,86	10,00	15,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	50.478.314,98	11,13	10,00	15,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	67.987.614,38	14,99				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

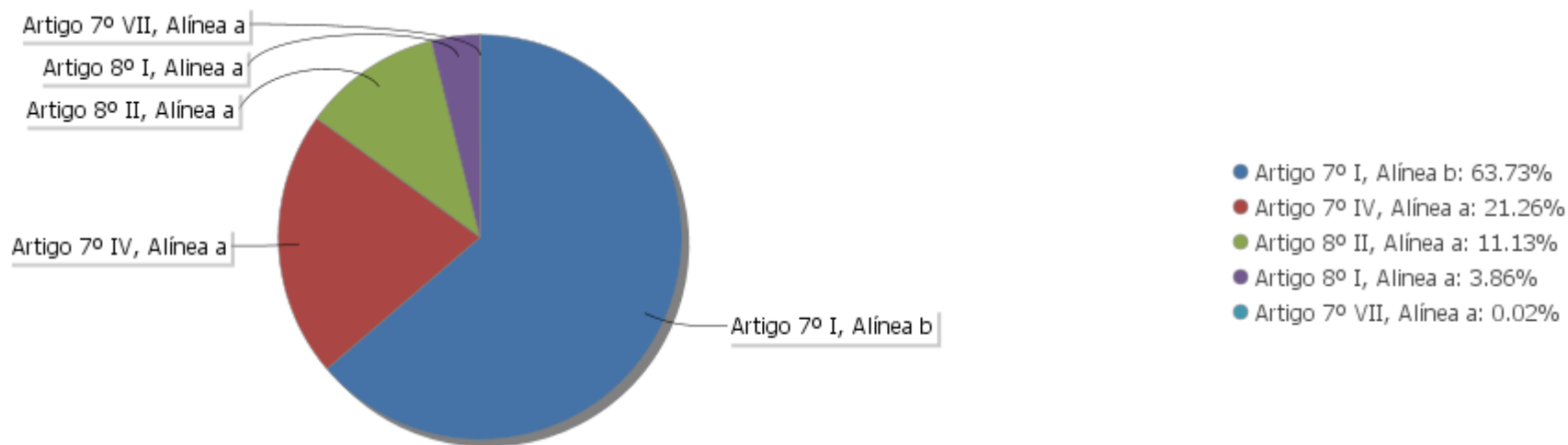
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,13 397,13	-3,40 -261,77	-3,70 -402,56	-3,28 -158,83	5,98 115,26	3.164.533,85	-10.276.469,46
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,69 242,77	-1,05 -80,44	-1,34 -145,21	-0,80 -38,91	7,70 148,35	664.610,68	-879.177,60
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-17,57 -6.165,99	-11,79 -907,29	-8,62 -937,36	45,16 2.185,84	25,26 486,52	-3.578,24	5.733,98
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,99 0,74	-29,95 0,43	-29,18 0,05	-23,91 1,00	-13,35 3,10	1.733.405,64	-7.487.608,64
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,06 -0,19	-29,22 1,17	-29,66 -0,43	-21,69 3,22	-8,21 8,24	4.406.424,66	-18.552.587,53
						9.965.396,59	-37.190.109,25

Análise de Liquidez

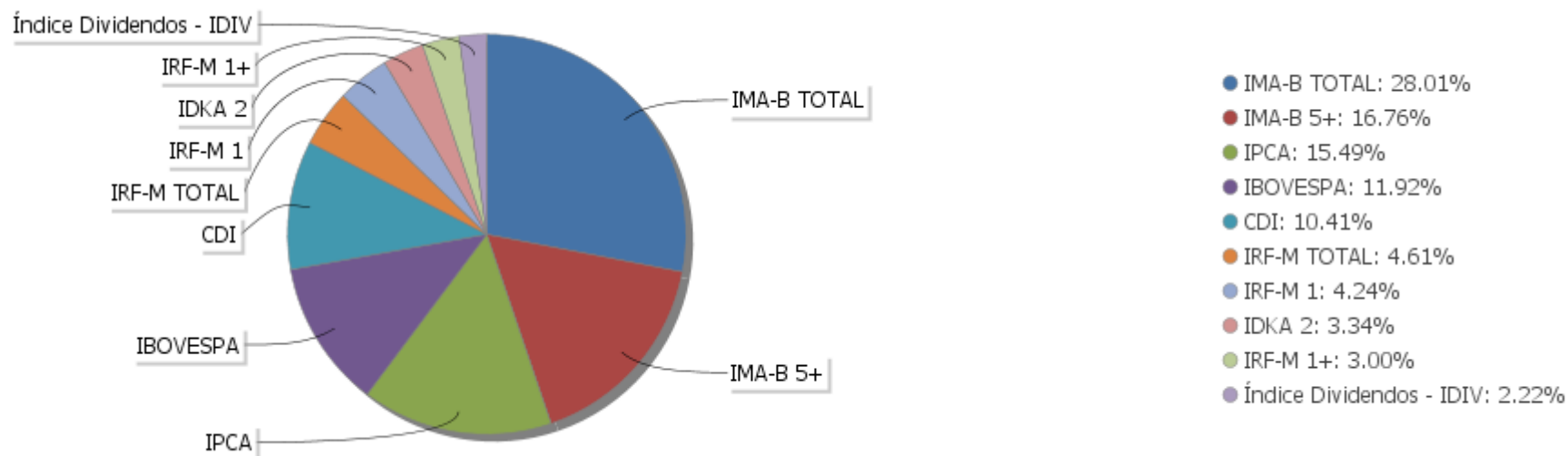
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	373.801.406,81	82,40	373.801.406,81	82,40
de 31 a 364 dias	78.460.862,70	17,30	452.262.269,51	99,70
acima de 365 dias	1.374.634,77	0,30	453.636.904,28	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

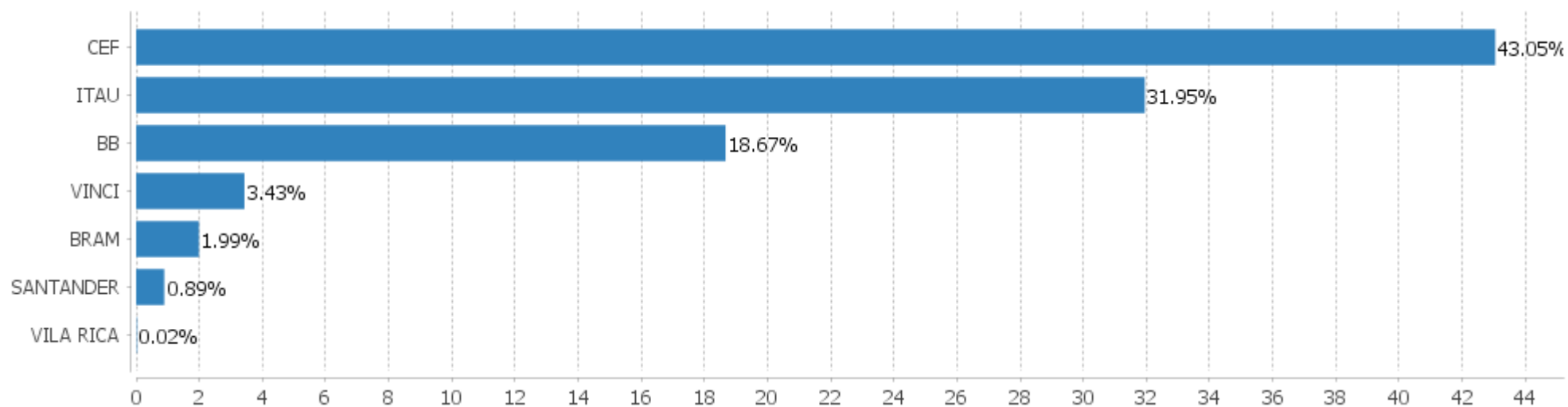


Alocação Por Estratégia



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	2,26									-7,64
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14									2,10
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11									-9,75
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

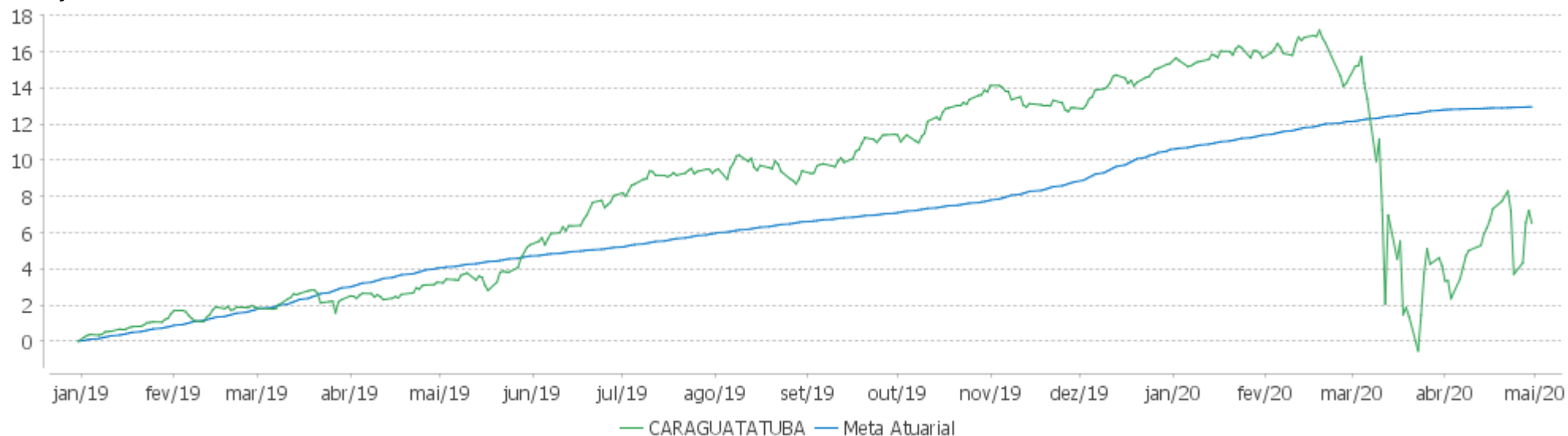
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

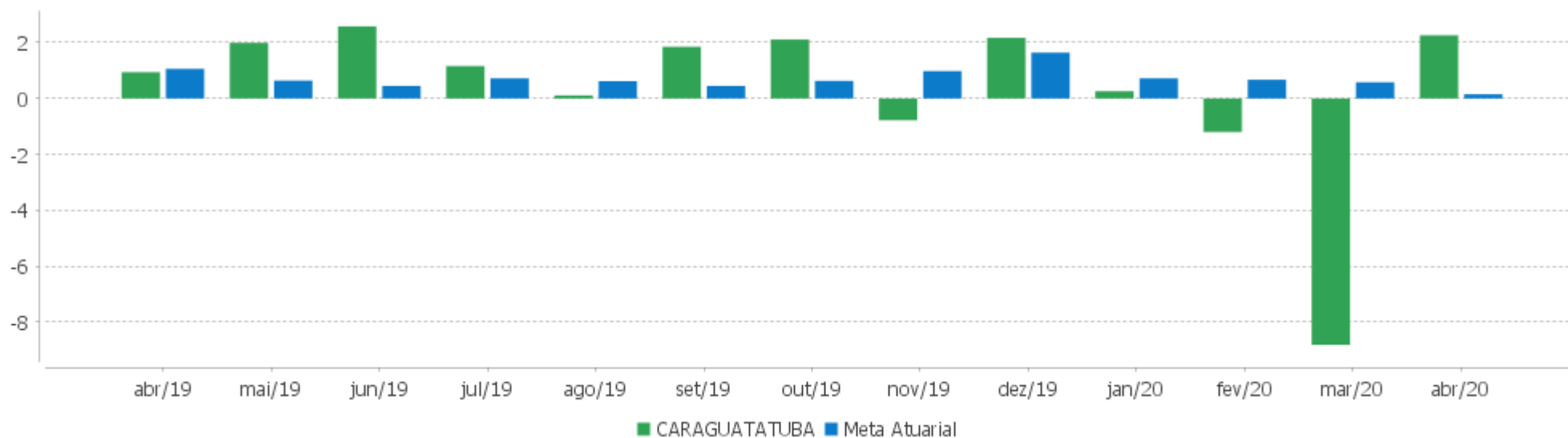
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	8	50,00	03 meses	-7,89	1,38	-9,27	24,11
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	50,00	06 meses	-6,38	4,79	-11,17	16,96
			12 meses	3,16	8,53	-5,37	12,13
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,58	2019-06	Desde 31/12/2018	6,52	12,92	-6,39	10,62
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03					

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
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-17,57 -6.165,99	-11,79 -907,29	-8,62 -937,36	45,16 2.185,84	25,26 486,52	1.425,75 12.016,38	172.338,98 823.536,90
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,43 -0,02	1,77 -0,12	1,33 -0,10	2,44 -0,21	6,32 -0,28	13,16 -0,56	23,06 -0,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,01	-5,25 -0,17	-5,48 -0,15	-5,82 -0,27	8,47 -0,47	25,17 -0,75	38,56 -1,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,41 -0,03	1,79 -0,09	1,37 -0,07	2,51 -0,14	6,31 -0,29	13,19 -0,53	23,04 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,13 -0,02	2,50 -0,09	1,65 -0,05	2,62 -0,13	11,40 -0,29	21,56 -0,51	36,77 -0,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	1,95 -0,07	-8,95 -0,13	-8,91 -0,06	-10,50 -0,25	7,94 -0,53	29,14 -1,18	42,37 -1,57
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	1,96 -0,05	-8,95 -0,13	-8,96 -0,11	-10,42 -0,17	8,03 -0,44	29,02 -1,30	41,72 -2,22
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02 -1,34	-0,94 4,13	-0,91 4,41	0,70 6,25	4,34 -4,59	12,57 -13,35	22,94 -16,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO Var. IRF-M 1+ p.p.	1,44 -0,06	2,87 -0,09	1,77 -0,05	2,71 -0,13	13,65 -0,27	25,31 -0,49	42,67 -0,98
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,02	-5,10 -0,02	-5,33 -0,00	-5,60 -0,05	8,71 -0,22	25,01 -0,90	38,05 -1,63
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,14 -1,17	-0,60 4,48	-0,79 4,53	0,75 6,30	5,98 -2,96	16,46 -9,45	28,78 -10,90
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,11 1,42	2,43 2,22	1,60 1,59	2,52 0,63	13,47 11,07	24,61 17,15	36,68 26,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,43 -0,15	0,02 -0,55	-0,44 -0,47	1,13 -0,67	7,34 -1,27	17,02 -1,82	30,50 -2,96
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,07 -0,08	2,47 -0,12	1,60 -0,10	2,60 -0,16	11,40 -0,29	21,53 -0,54	36,72 -0,97
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,02	-5,12 -0,04	-5,36 -0,04	-5,65 -0,09	8,71 -0,22	25,32 -0,60	38,67 -1,01
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	1,92 -0,10	-8,86 -0,05	-8,90 -0,06	-10,22 0,03	8,35 -0,13	29,79 -0,53	42,72 -1,22
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	1,26	-5,37	-5,60	-5,88	8,37	24,95	38,35

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.	-0,06	-0,29	-0,27	-0,33	-0,56	-0,96	-1,33
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,08 28,63	0,97 74,91	0,60 65,26	1,66 80,18	4,70 90,43	11,20 94,37	20,09 95,98
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	1,53 537,07	-3,82 -293,56	-4,01 -436,26	-4,58 -221,65	11,67 224,70	28,88 243,38	42,18 201,56
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,00 1,22	0,79 60,96	0,42 45,66	1,46 70,60	4,46 85,97	10,92 92,02	19,81 94,64
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 0,45	1,28 1,06	0,93 0,92	1,98 0,09	9,19 6,79	18,37 10,91	30,21 19,78
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	6,84 -3,41	-35,78 -5,39	-34,94 -5,71	-32,16 -7,24	-22,88 -6,43	-12,14 -5,63	23,38 0,29
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	10,96 0,71	-27,83 2,56	-28,74 0,50	-19,92 4,99	-8,83 7,62	6,62 13,14	40,57 17,48
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	9,76 -0,50	-28,15 2,24	-29,52 -0,29	-17,60 7,32	-1,76 14,69	13,43 19,95	49,59 26,49
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,03	-32,47	-32,34	-25,59	-9,53	3,07	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,24 3,48	-25,99 2,66	-27,10 0,40	-19,26 0,43	-7,99 -0,81	9,76 -0,62	35,45 4,69
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	11,57 1,32	-28,87 1,51	-29,35 -0,12	-21,99 2,93	-11,31 5,14	0,22 6,73	28,18 5,09
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	8,38 -1,87	-30,43 -0,05	-30,14 -0,91	-24,64 0,27	-16,90 -0,45	-6,36 0,15	15,49 -7,60
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	14,55 4,30	-26,73 3,66	-27,89 1,34	-16,66 8,25	-2,86 13,59	17,53 24,04	56,54 33,45
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	10,99 0,74	-29,95 0,43	-29,18 0,05	-23,91 1,00	-13,93 2,51	-0,75 5,76	23,50 0,41
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

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	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
Renda Variável							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,96	6,68	15,90	18,09
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

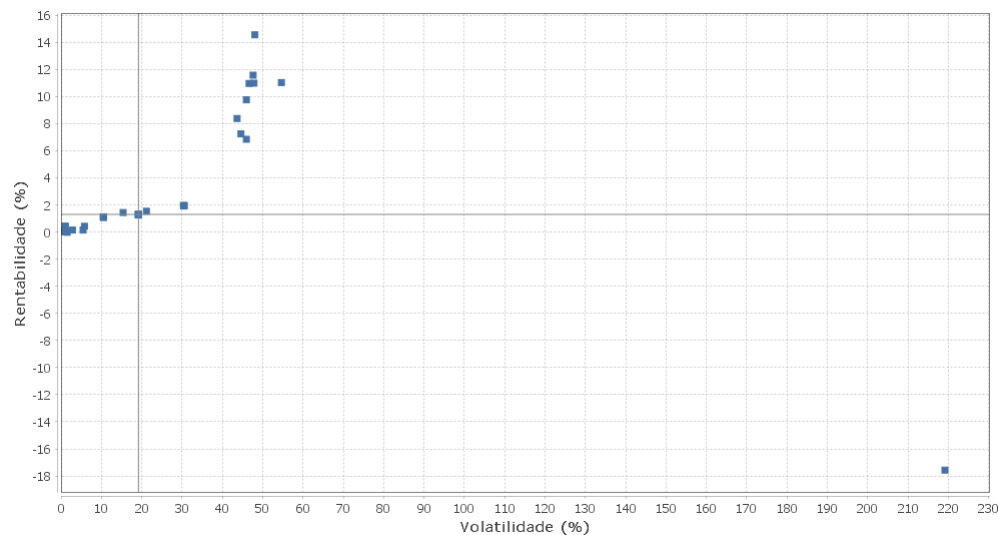
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
80	08/04/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	897.626,42	0,00	27.116,69202287	33,1023570000
81	09/04/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	17.400,00	525,54902203	33,1082340000
82	09/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	53.427,50	0,00	17,03361521	3.136,5919290000
83	09/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	37.000,00	10.081,49876800	3,6700890000
84	16/04/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	378.433,55	0,00	141.449,27472300	2,6754011340
85	16/04/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.232,22	0,00	3.450,77972800	2,6754011340
86	16/04/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	237.376,18	0,00	88.725,45390700	2,6754011340
87	16/04/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.655,70	0,00	618,86046800	2,6754011340
88	16/04/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.247.276,09	0,00	67.801,79814708	33,1447860000
89	22/04/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	562.963,40	0,00	16.963,69884988	33,1863590000
90	24/04/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	3.000.000,00	90.336,54337214	33,2091520000
91	27/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	107.313,41	0,00	34,17510877	3.140,1044170000
92	27/04/2020	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3.000.000,00	0,00	1.355.595,83181394	2,2130490000
93	29/04/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.127.104,14	64.065,97273393	33,2017770000
94	29/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,36868918	3.141,8760710000
95	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	142.846,11	38.822,09969300	3,6795050000
96	30/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.264,23	0,00	0,40229948	3.142,5096910000
97	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.000,00	1.630,36699800	3,6801530000

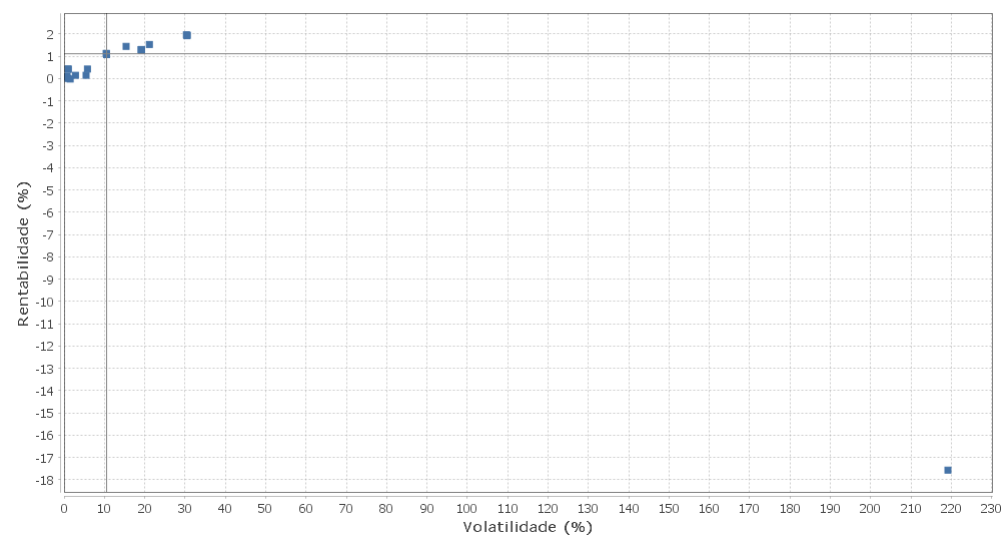
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

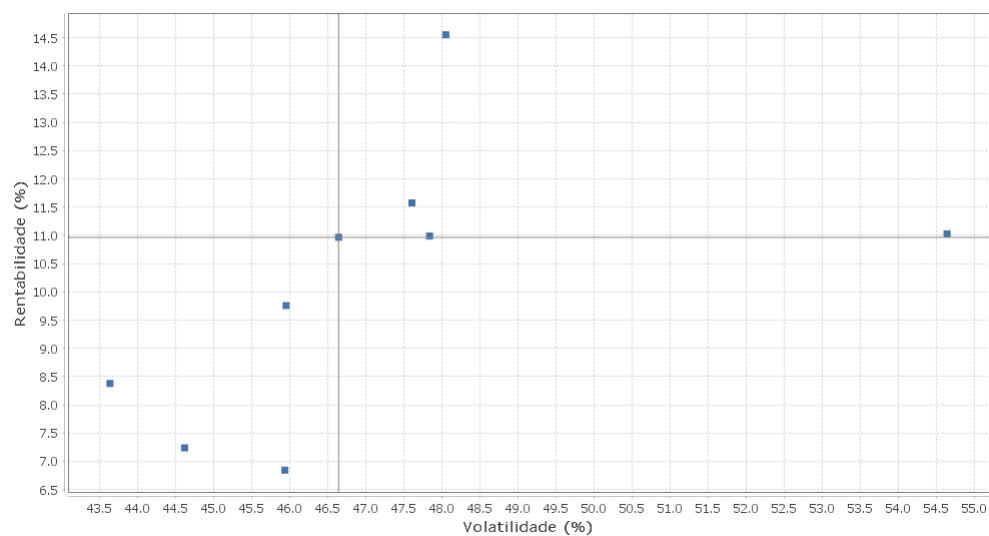
CARAGUATATUBA - No Mês



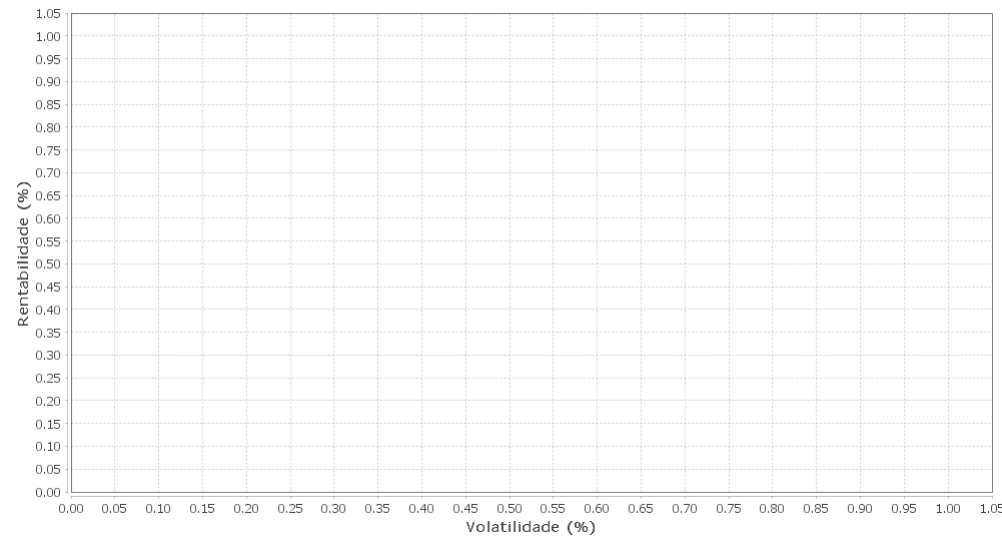
Renda Fixa - No Mês



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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,73	0,08	0,08	4.977.349,78	1,10
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,95	0,10	0,00	2.617.639,49	0,58
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,13	0,41	11.712.269,07	2,58
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,13	0,43	7.325.031,28	1,61
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	0,16	-0,02	49.897.240,00	11,00
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,81	0,30	0,14	1.289.397,44	0,28
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	5,46	0,57	0,14	49.743.532,91	10,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,81	0,62	0,43	15.001.115,24	3,31
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,49	1,14	1,11	19.860.741,14	4,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,50	1,14	1,13	4.814.192,09	1,06
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	10,56	1,15	1,07	15.891.138,23	3,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	15,40	1,67	1,44	13.483.449,75	2,97
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	19,12	2,05	1,30	14.020.618,16	3,09
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	19,16	2,05	1,30	15.196.959,31	3,35
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	19,19	2,05	1,30	41.312.230,22	9,11
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	19,20	2,05	1,26	4.059.949,51	0,89
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	21,17	2,27	1,53	39.103.805,25	8,62
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	30,34	3,24	1,96	3.906.220,07	0,86
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	30,47	3,25	1,92	23.044.773,90	5,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	30,55	3,26	1,95	48.306.399,73	10,65
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	43,63	4,92	8,38	1.207.362,42	0,27
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	44,62	4,97	7,24	9.971.339,58	2,20
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	45,94	5,09	6,84	4.005.559,12	0,88
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	45,95	5,23	9,76	5.598.532,62	1,23
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	46,64	5,35	10,96	8.503.303,16	1,87
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	47,60	5,48	11,57	11.679.636,56	2,57
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	47,84	5,48	10,99	17.509.299,40	3,86
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	48,05	5,66	14,55	5.022.134,18	1,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	54,64	6,18	11,03	4.490.447,34	0,99
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	219,14	21,74	-17,57	85.237,33	0,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de abril de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso I, Alínea A (3,86% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.