



CARAGUATATUBA
JUNHO 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

83,37%

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	5,84	0,77	4,68	16.234.472,52	3,41	5.220.862.294,67	0,31
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,52	0,28	2,46	7.365.772,74	1,55	217.812.640,04	3,38
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,35	2,00	-1,78	15.728.902,44	3,30	362.047.246,48	4,34
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	12.913.679,00	2,71	7.792.694.548,07	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-3,21	14.518.522,52	3,05	5.526.503.185,82	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	42.781.379,85	8,99	5.979.262.081,07	0,72
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,05	2,80	-5,38	23.926.371,43	5,03	1.945.603.761,59	1,23
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,44	2,00	-2,68	4.203.125,91	0,88	1.214.596.338,04	0,35
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	19,01	2,82	-5,53	4.052.953,67	0,85	83.260.620,22	4,87
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,16	2,83	-5,44	50.168.892,67	10,54	1.967.228.116,14	2,55
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	8,67	1,02	5,88	13.878.098,60	2,92	2.971.560.297,96	0,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,01	1,18	3,12	15.466.612,29	3,25	7.740.606.629,29	0,20
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	0,77	4,73	4.918.837,70	1,03	17.164.831.993,69	0,03
BB	BB	BB PREV RF VII	2,30	0,99	1,64	1.318.443,68	0,28	683.688.528,70	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	20.285.497,16	4,26	12.211.119.756,17	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,21	0,89	0,74	50.745.080,00	10,66	1.000.064.153,24	5,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,27	1,64	-0,66	298.506.642,18	62,70		

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	0,27	1,49	5.294.996,79	1,11	842.540.331,15	0,63
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,21	1,99	-0,34	40.517.300,60	8,51	433.601.892,28	9,34
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,24	1,37	2.245.460,78	0,47	5.172.945.706,81	0,04

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	1,67	0,44	2,27	50.230.354,27	10,55	5.170.951.886,47	0,97
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,19	1,06	0,95	98.288.112,44	20,65		

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	112,37	13,78	10,71	106.985,98	0,02	3.695.750,72	2,89
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			112,37	13,78	10,71	106.985,98	0,02		

Renda Fixa			8,52	1,50	-0,29	396.901.740,60	83,37		
-------------------	--	--	-------------	-------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,63%

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	43,93	8,89	-17,46	20.632.023,87	4,33	828.382.101,16	2,49
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,93	8,89	-17,46	20.632.023,87	4,33		

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	43,05	8,95	-24,53	4.707.170,89	0,99	671.878.055,53	0,70
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	37,97	6,59	-22,29	1.348.647,13	0,28	907.675.512,87	0,15
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	42,99	8,50	-15,58	5.785.755,67	1,22	1.989.712.475,16	0,29
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,37	8,62	-16,61	13.693.120,04	2,88	769.821.540,22	1,78
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	40,99	9,33	-15,92	6.551.111,96	1,38	529.679.544,23	1,24
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	11.210.886,66	2,35	799.344.501,83	1,40
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	41,04	11,47	-16,20	10.056.426,22	2,11	1.573.476.047,46	0,64
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	42,89	9,28	-22,25	5.170.146,65	1,09	3.271.734.214,80	0,16
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,88	8,40	-17,94	58.523.265,22	12,29		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,64	8,53	-17,92	79.155.289,09	16,63		
--	--	--	--------------	-------------	---------------	----------------------	--------------	--	--

Total						476.057.029,69	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	298.506.642,18	62,70	10,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	98.288.112,44	20,65	1,00	10,00	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	106.985,98	0,02	0,01	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	396.901.740,60	83,37				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	20.632.023,87	4,33	10,00	15,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	58.523.265,22	12,29	10,00	15,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	79.155.289,09	16,63				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

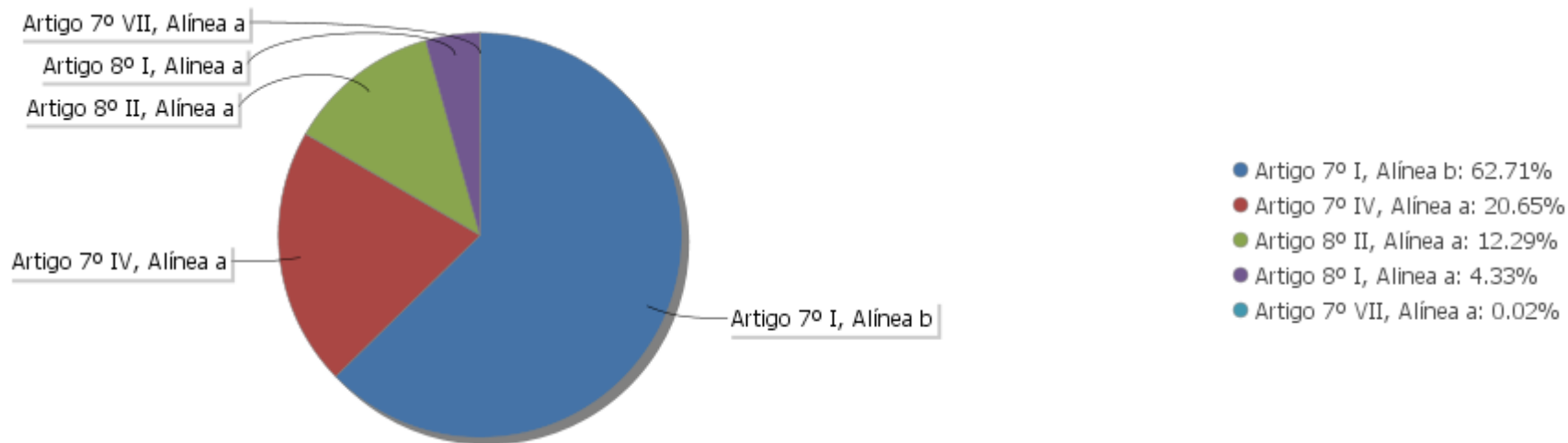
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,64 770,38	-0,66 -37,55	4,00 544,92	-0,66 -37,55	4,53 98,31	4.818.545,45	-1.999.606,90
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,06 498,28	0,95 53,94	2,72 369,97	0,95 53,94	5,28 114,76	1.029.613,51	1.061.639,52
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	13,78 6.491,53	10,71 610,60	3,46 471,42	10,71 610,60	38,24 830,70	12.959,91	27.482,63
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,89 0,14	-17,46 0,34	30,78 0,60	-17,46 0,34	-3,53 2,33	1.685.200,07	-4.364.884,17
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,40 -0,36	-17,94 -0,13	27,61 -2,57	-17,94 -0,13	-0,39 5,47	4.533.768,75	-10.507.637,29
						12.080.087,69	-15.783.006,21

Análise de Liquidez

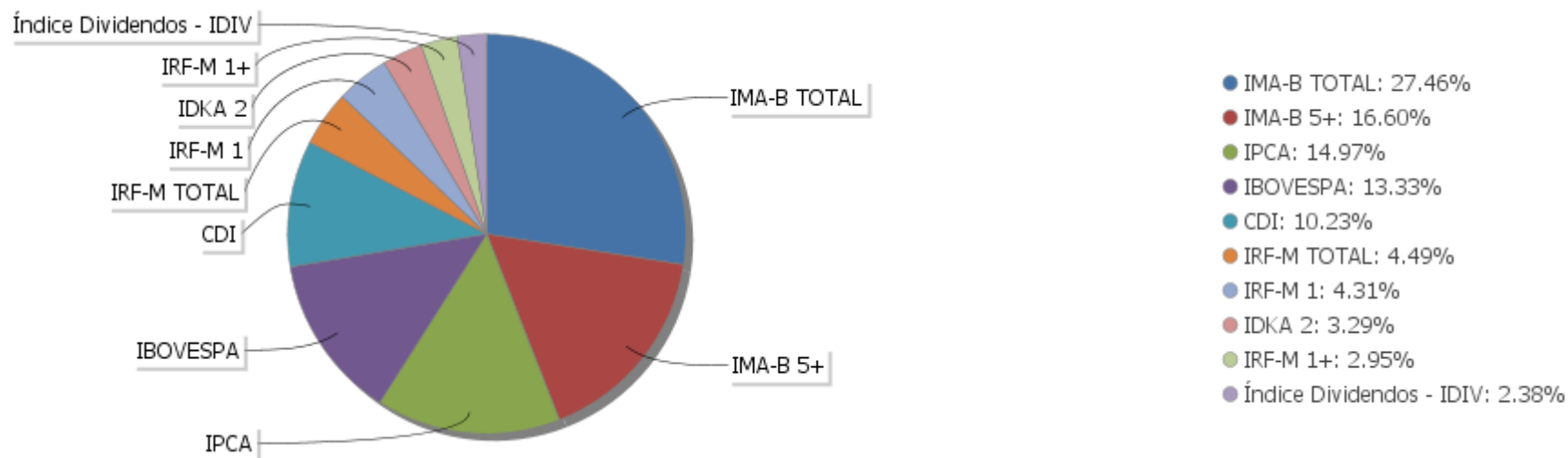
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	390.897.948,54	82,11	390.897.948,54	82,11
de 31 a 364 dias	83.733.651,49	17,59	474.631.600,03	99,70
acima de 365 dias	1.425.429,66	0,30	476.057.029,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

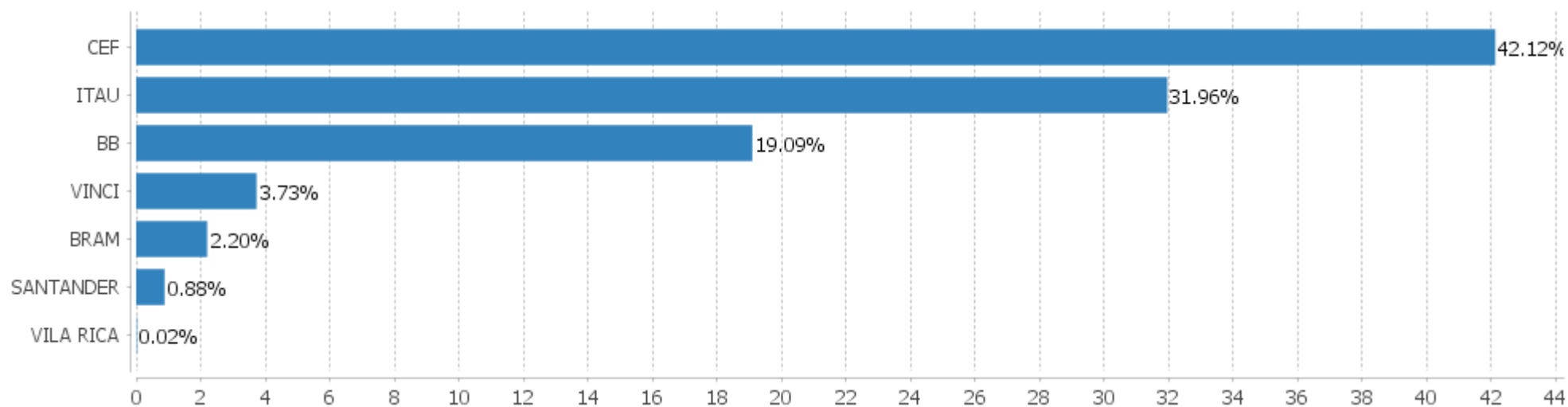


Alocação Por Estratégia



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	2,04	2,60							-3,31
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,93
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86							-6,24
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

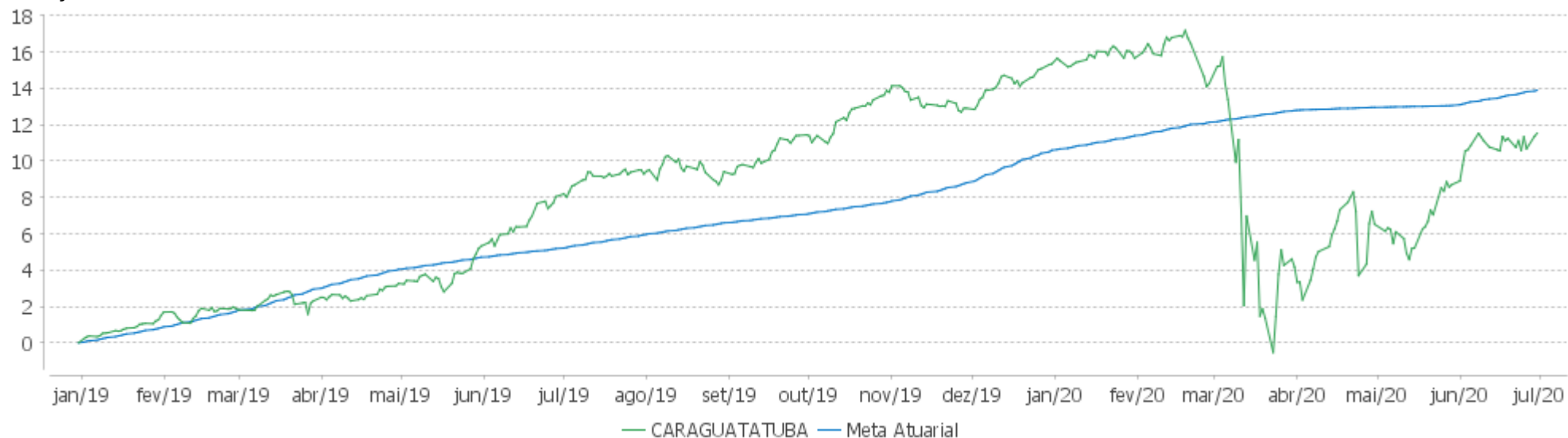
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

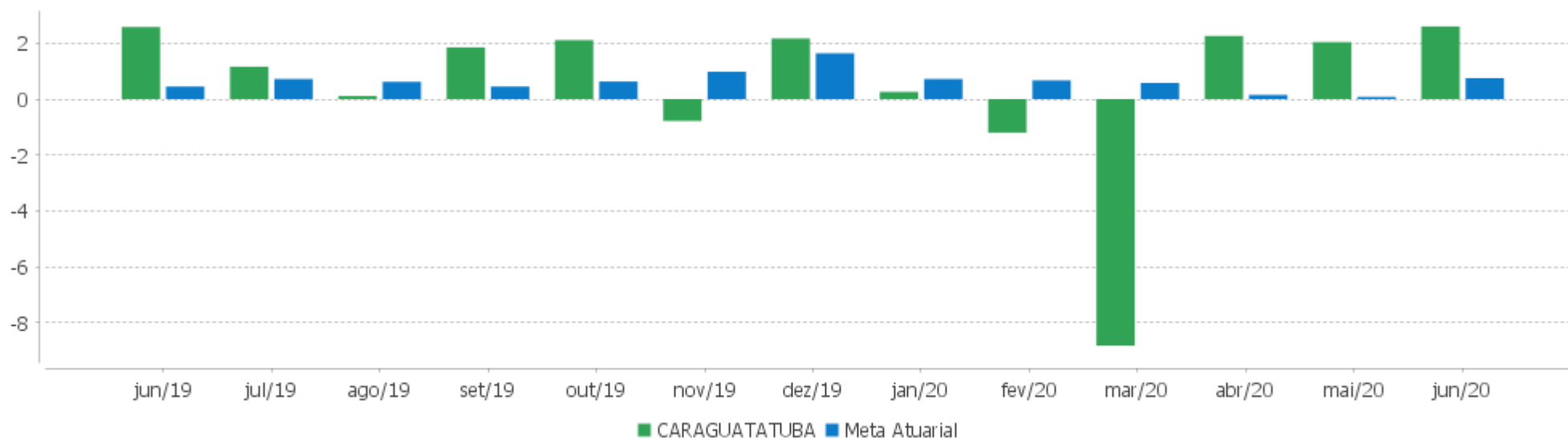
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	10	55,56	03 meses	7,06	0,96	6,10	11,60
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	44,44	06 meses	-3,31	2,93	-6,24	17,48
			12 meses	3,23	8,23	-5,00	12,42
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2020-06	Desde 31/12/2018	11,53	13,83	-2,31	10,34
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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,27 126,53	1,49 85,18	0,60 81,31	1,49 85,18	4,20 91,24	10,65 94,95	18,64 96,11
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	1,99 938,88	-0,34 -19,33	5,20 707,68	-0,34 -19,33	6,72 145,89	38,42 342,63	49,17 253,57
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,24 114,33	1,37 78,02	0,58 78,30	1,37 78,02	4,03 87,52	10,44 93,15	18,40 94,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,44 0,18	2,27 2,17	1,12 1,55	2,27 2,17	5,62 3,49	19,25 13,67	31,68 21,48
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,00	2,46 -0,14	1,11 -0,03	2,46 -0,14	5,77 -0,24	13,16 -0,51	21,73 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,03	2,45 -0,14	1,06 -0,09	2,45 -0,14	5,71 -0,30	13,15 -0,52	21,70 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,77 -0,02	4,73 -0,13	3,33 -0,06	4,73 -0,13	9,54 -0,27	26,59 -0,49	37,48 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,83 -0,02	-5,44 -0,17	5,88 -0,11	-5,44 -0,17	1,57 -0,40	42,12 -1,44	50,48 -1,85
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,82 -0,03	-5,53 -0,27	5,79 -0,20	-5,53 -0,27	1,50 -0,47	42,11 -1,45	49,97 -2,36
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 -1,16	0,74 2,40	1,68 -3,28	0,74 2,40	4,90 -0,05	15,30 -19,83	24,27 -21,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO Var. IRF-M 1+ p.p.	1,02 -0,02	5,88 -0,15	4,41 -0,12	5,88 -0,15	11,53 -0,26	32,77 -0,47	44,55 -1,05
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,00 -0,05	-1,78 -0,12	4,84 -0,12	-1,78 -0,12	4,69 -0,25	34,14 -0,99	44,48 -1,73
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 -1,06	1,64 3,31	2,40 -2,56	1,64 3,31	6,28 1,33	19,00 -16,13	30,65 -15,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	4,63 4,53	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,18 0,19	3,12 -0,23	3,54 0,19	3,12 -0,23	8,19 -0,58	21,36 -1,81	33,16 -2,29
BB PREV RF IRF-M	0,77	4,68	3,26	4,68	9,51	26,49	37,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,01	-0,18	-0,13	-0,18	-0,30	-0,59	-0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,02	-1,75	4,90	-1,75	4,74	34,48	45,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,08	-0,06	-0,08	-0,20	-0,65	-1,09
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,80	-5,38	5,82	-5,38	1,87	42,80	51,23
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04	-0,11	-0,17	-0,11	-0,10	-0,75	-1,10
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	2,00	-2,03	4,83	-2,03	4,40	34,09	44,71
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,37	-0,13	-0,37	-0,54	-1,04	-1,49
FIDC ITALIA SENIOR	13,78	10,71	3,46	10,71	38,24	2.054,57	218.900,60
% do CDI	6.491,53	610,60	471,42	610,60	830,70	18.323,37	1.128.908,74
BRADESCO F I A SELECTION	8,95	-24,53	25,56	-24,53	-13,47	19,34	54,11
Var. IBOVESPA p.p.	0,20	-6,73	-4,62	-6,73	-7,62	-11,30	2,98
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	11,47	-14,65	31,23	-14,65	0,85	42,00	73,22
Var. IBOVESPA p.p.	2,71	3,16	1,05	3,16	6,71	11,36	22,09
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	9,33	-15,92	28,43	-15,92	5,63	56,90	79,52
Var. IBOVESPA p.p.	0,57	1,88	-1,75	1,88	11,48	26,26	28,40
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	9,28	-22,25	27,83	-22,25	-4,41	36,54	
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8,62	-16,61	30,81	-16,61	-1,66	35,75	55,33
Var. IBOVESPA p.p.	-0,14	1,19	0,63	1,19	4,19	5,11	4,21
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4,58	-16,79	20,57	-16,79	-2,34	45,78	57,70
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,37	1,59	1,87	1,59	-2,18	-1,73	-2,87
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,59	-22,29	21,06	-22,29	-12,10	24,15	32,50
Var. IBOVESPA p.p.	-2,17	-4,49	-9,12	-4,49	-6,25	-6,49	-18,62
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	8,50	-15,58	31,97	-15,58	6,25	52,81	84,44
Var. IBOVESPA p.p.	-0,26	2,22	1,79	2,22	12,11	22,17	33,32
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,89	-17,46	30,78	-17,46	-3,93	35,59	49,22
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	0,34	0,60	0,34	1,92	4,96	-1,90
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
Renda Variável							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

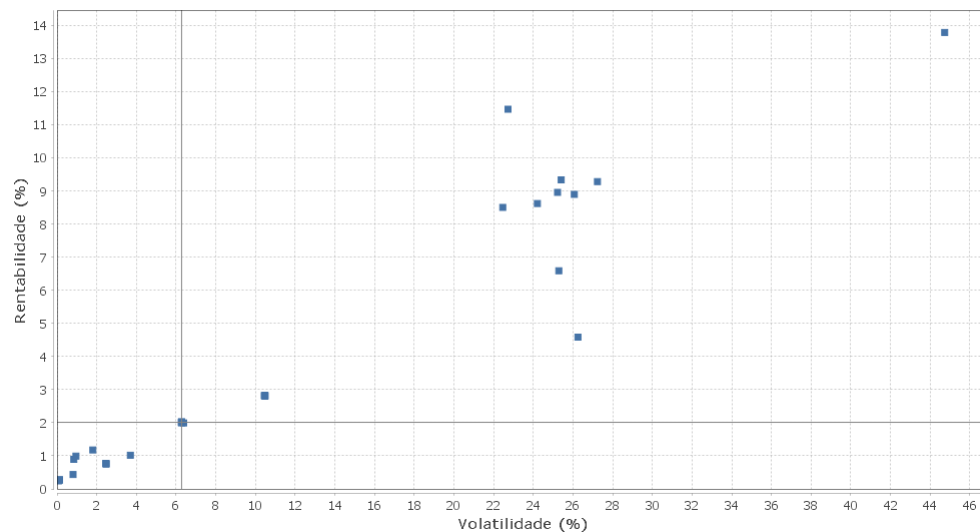
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
114	05/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	289.757,01	0,00	107.574,69967100	2,6935423560
115	05/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.232,22	0,00	3.427,53845300	2,6935423560
116	10/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.655,70	0,00	614,54145600	2,6942039180
117	10/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	36.000,00	9.740,04892100	3,6960800000
118	17/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.735,88	0,00	643,92041600	2,6957989790
119	17/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	237.376,18	0,00	88.054,11006100	2,6957989790
120	22/06/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.404.549,40	0,00	42.030,51885890	33,4173700000
121	25/06/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	107.944,72	0,00	34,19170090	3.157,0444630000
122	29/06/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.145.283,87	64.176,99851916	33,4276130000
123	29/06/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,34587990	3.158,3661570000
124	29/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	141.983,61	38.366,03689000	3,7007630000
125	30/06/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.264,23	0,00	0,40023620	3.158,7097760000

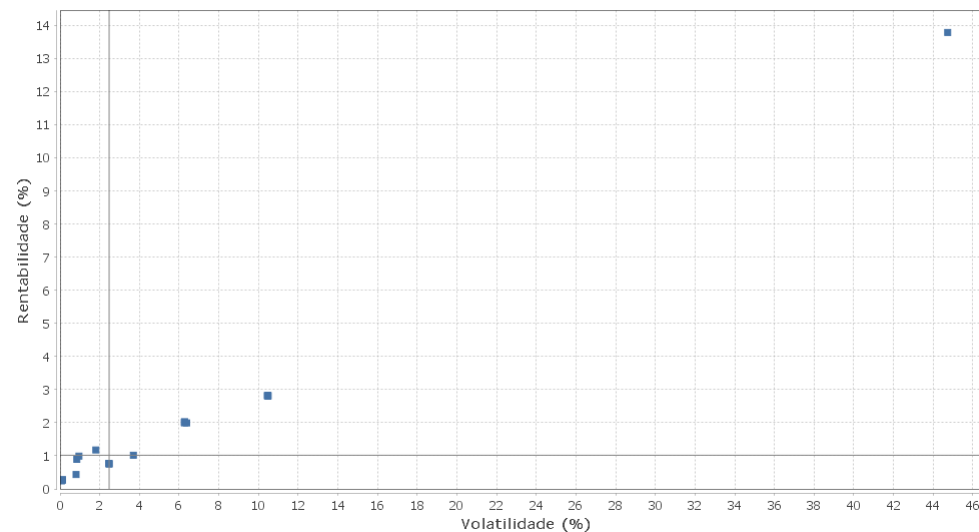
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

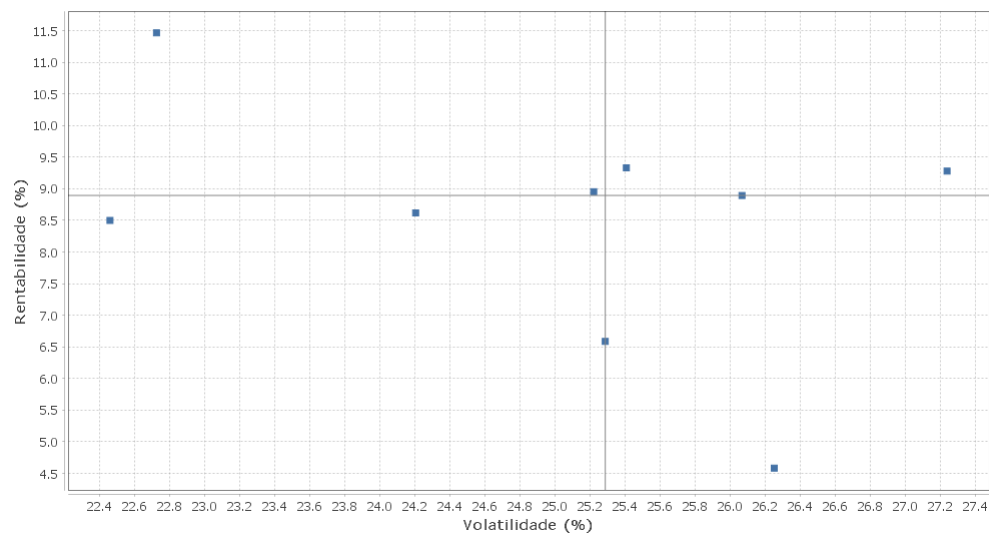
CARAGUATATUBA - No Mês



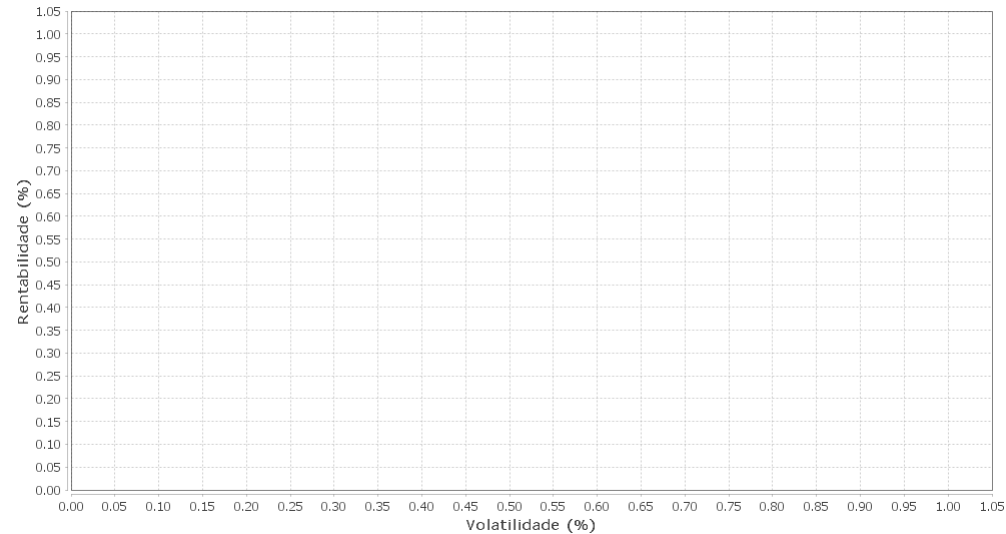
Renda Fixa - No Mês



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	0,07	0,02	0,24	2.245.460,78	0,47
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,02	0,27	5.294.996,79	1,11
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	12.913.679,00	2,71
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,13	0,03	0,28	7.365.772,74	1,55
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,81	0,10	0,44	50.230.354,27	10,55
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,85	0,13	0,89	50.745.080,00	10,66
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,95	0,15	0,99	1.318.443,68	0,28
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,24	1,18	15.466.612,29	3,25
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	0,29	0,77	16.234.472,52	3,41
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,75	20.285.497,16	4,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,77	4.918.837,70	1,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	0,43	1,02	13.878.098,60	2,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	0,74	2,02	14.518.522,52	3,05
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	0,74	2,00	15.728.902,44	3,30
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,74	2,00	4.203.125,91	0,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,75	2,03	42.781.379,85	8,99
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,38	0,76	1,99	40.517.300,60	8,51
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,44	1,21	2,82	4.052.953,67	0,85
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,48	1,22	2,83	50.168.892,67	10,54
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,48	1,22	2,80	23.926.371,43	5,03
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,46	2,72	8,50	5.785.755,67	1,22
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	22,73	2,87	11,47	10.056.426,22	2,11
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,20	2,90	8,62	13.693.120,04	2,88
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	25,22	3,02	8,95	4.707.170,89	0,99
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	25,29	2,92	6,59	1.348.647,13	0,28
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,41	3,06	9,33	6.551.111,96	1,38
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	26,07	3,11	8,89	20.632.023,87	4,33
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	2,93	4,58	11.210.886,66	2,35
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	27,24	3,24	9,28	5.170.146,65	1,09
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	44,73	5,25	13,78	106.985,98	0,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de junho de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso I, Alínea A (4,33% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.