



CARAGUATATUBA
OUTUBRO 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 11.11.2020.

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

81,92%

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	6,05	-0,31	3,99	16.127.619,85	3,34	4.799.950.020,87	0,34
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,57	0,12	2,93	8.917.363,02	1,84	238.642.925,27	3,74
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,72	0,18	-0,73	15.896.995,32	3,29	371.278.279,20	4,28
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,56	0,11	2,94	7.882.494,92	1,63	7.887.722.403,08	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,77	0,20	-2,21	15.516.886,55	3,21	5.529.359.748,67	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,83	0,19	-0,81	43.247.136,95	8,95	5.818.645.931,87	0,74
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,71	0,20	-4,62	24.116.097,70	4,99	1.936.566.655,94	1,25
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,81	0,19	-1,64	4.248.162,76	0,88	1.209.283.118,14	0,35
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	19,66	0,21	-4,69	4.088.950,92	0,85	78.441.211,22	5,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,82	0,22	-4,61	50.605.189,83	10,47	1.789.450.540,00	2,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,97	-0,56	4,57	33.346.876,69	6,90	3.143.067.959,97	1,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,15	5,00	15.748.092,46	3,26	9.550.097.040,26	0,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,03	-0,36	4,04	4.886.294,70	1,01	9.226.615.794,13	0,05
BB	BB	BB PREV RF VII	2,40	0,49	3,15	463.036,62	0,10	240.126.324,03	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	50.847.231,45	10,52	13.635.004.724,81	0,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,74	0,02	-0,15	295.938.429,74	61,21		

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	0,15	2,18	5.972.798,89	1,24	1.263.231.581,08	0,47
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,59	-0,00	0,38	40.810.801,06	8,44	640.033.097,32	6,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	0,12	1,89	1.516.500,08	0,31	4.647.429.126,31	0,03

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	0,08	2,55	50.367.792,03	10,42	4.590.560.763,79	1,10
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,44	0,05	1,44	98.667.892,06	20,41		

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	245,12	36,83	1.410,48	1.425.440,09	0,29	41.677.967,18	3,42
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			245,12	36,83	1.410,48	1.425.440,09	0,29		

Renda Fixa			8,91	0,12	0,54	396.031.761,89	81,92		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,39%

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 AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,95	-0,82	-18,46	20.383.712,14	4,22	897.089.282,83	2,27
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,95	-0,82	-18,46	20.383.712,14	4,22		

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	43,96	3,33	-17,49	5.146.342,28	1,06	713.271.813,28	0,72
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,79	-1,45	-24,73	1.306.254,86	0,27	871.977.000,93	0,15
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,96	-2,46	-16,71	5.708.399,87	1,18	1.939.742.217,75	0,29
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,30	-1,33	-17,14	13.606.974,13	2,81	792.105.434,37	1,72
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,79	-1,78	-16,91	6.474.030,26	1,34	581.510.916,63	1,11
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,50	0,05	-17,54	11.109.429,19	2,30	793.160.820,76	1,40
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,16	-1,78	-14,77	10.227.117,71	2,12	1.834.784.580,50	0,56
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,90	0,50	-20,29	5.299.905,97	1,10	3.130.548.860,93	0,17
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,78	-0,76	-17,44	58.878.454,27	12,18		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			42,56	-0,78	-17,81	79.262.166,41	16,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,69%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	29,24	-1,77	5,37	8.167.572,62	1,69	1.678.449.679,91	0,49
Sub-total Artigo 9º A, III			29,24	-1,77	5,37	8.167.572,62	1,69		
Investimentos no Exterior			29,15	-1,77	5,37	8.167.572,62	1,69		
Total			12,94	-0,06	-2,55	483.461.500,92	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	295.938.429,74	61,21	10,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	98.667.892,06	20,41	1,00	19,50	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.425.440,09	0,29	0,01	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	396.031.761,89	81,92				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	20.383.712,14	4,22	3,00	5,00	10,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	58.878.454,27	12,18	10,00	15,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	79.262.166,41	16,39				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.167.572,62	1,69	0,00	5,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.167.572,62	1,69				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

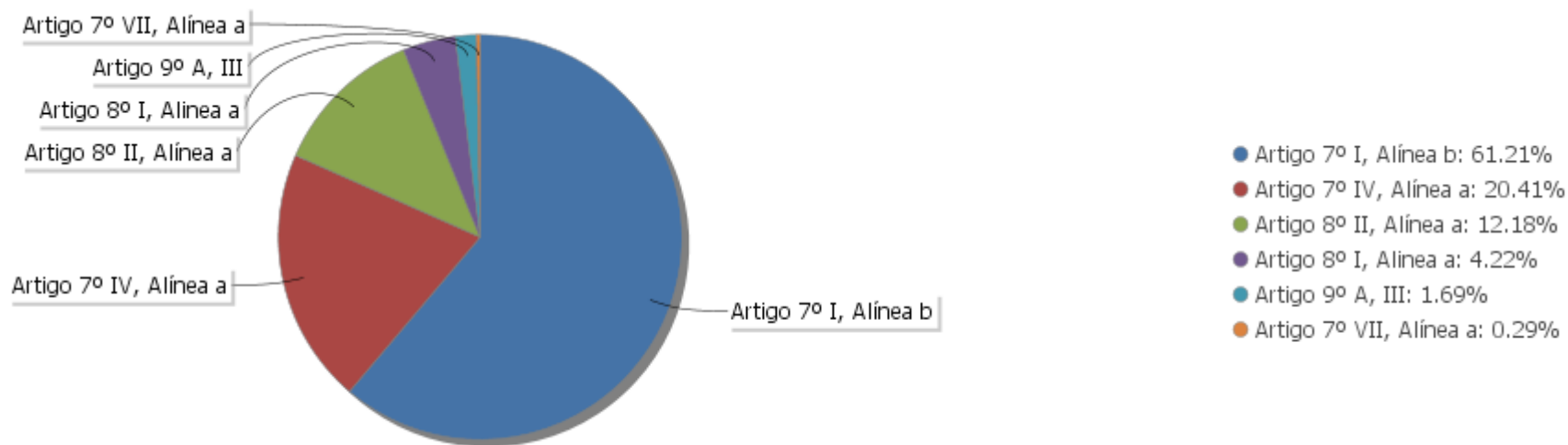
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,02 12,04	-0,15 -6,33	-2,72 -572,65	3,36 299,87	-0,03 -0,91	49.875,93	-993.748,30
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,05 31,96	1,44 58,99	-1,61 -338,65	2,51 223,71	1,68 52,47	49.541,74	1.540.427,11
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	36,83 23.463,53	1.410,48 57.902,08	1.265,63 266.682,17	1.612,44 143.777,41	2.385,87 74.305,11	383.687,36	1.371.378,40
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,82 -0,13	-18,46 0,30	-8,89 -0,19	16,42 -0,29	-11,42 0,95	-167.794,89	-4.613.195,90
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,76 -0,07	-17,44 1,32	-7,38 1,33	16,64 -0,06	-8,66 3,71	-451.650,96	-10.152.448,24
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,77 -1.128,76	5,37 2.875,04				-123.391,95	167.572,62
						-259.732,77	-12.680.014,31

Análise de Liquidez

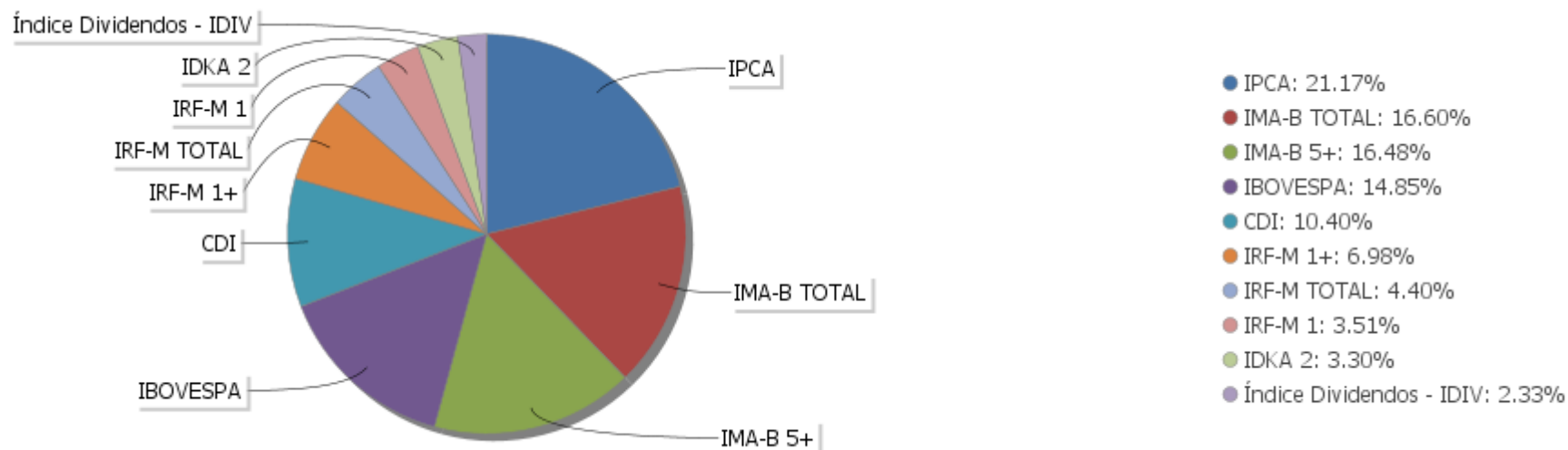
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	448.462.541,08	92,76	448.462.541,08	92,76
de 31 a 364 dias	33.110.483,13	6,85	481.573.024,21	99,61
acima de 365 dias	1.888.476,71	0,39	483.461.500,92	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

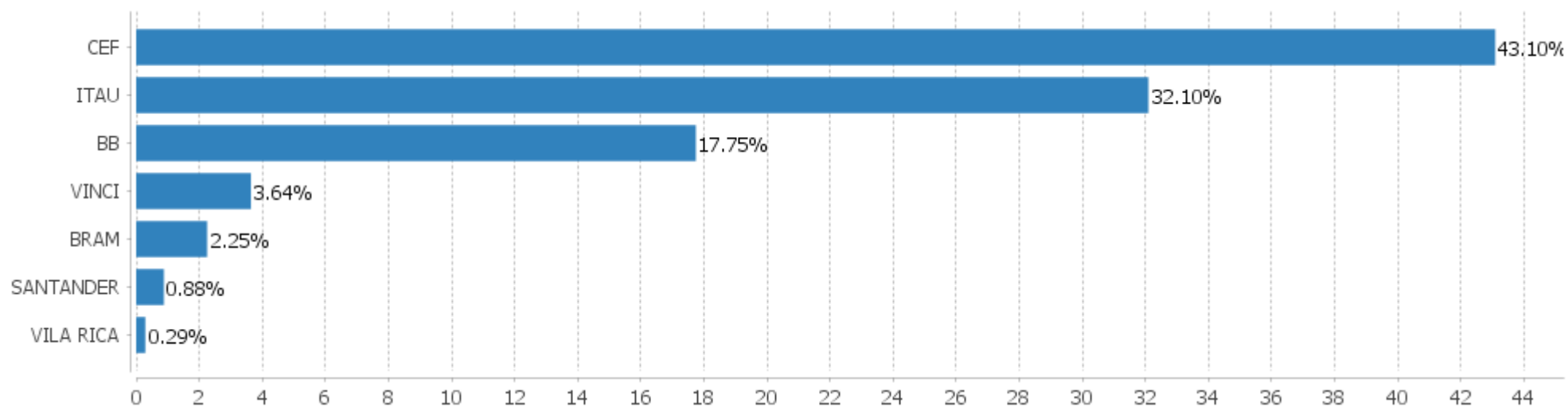


Alocação Por Estratégia



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	3,94	-1,32	-1,68	-0,06			-2,55
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34			7,18
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40			-9,73
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

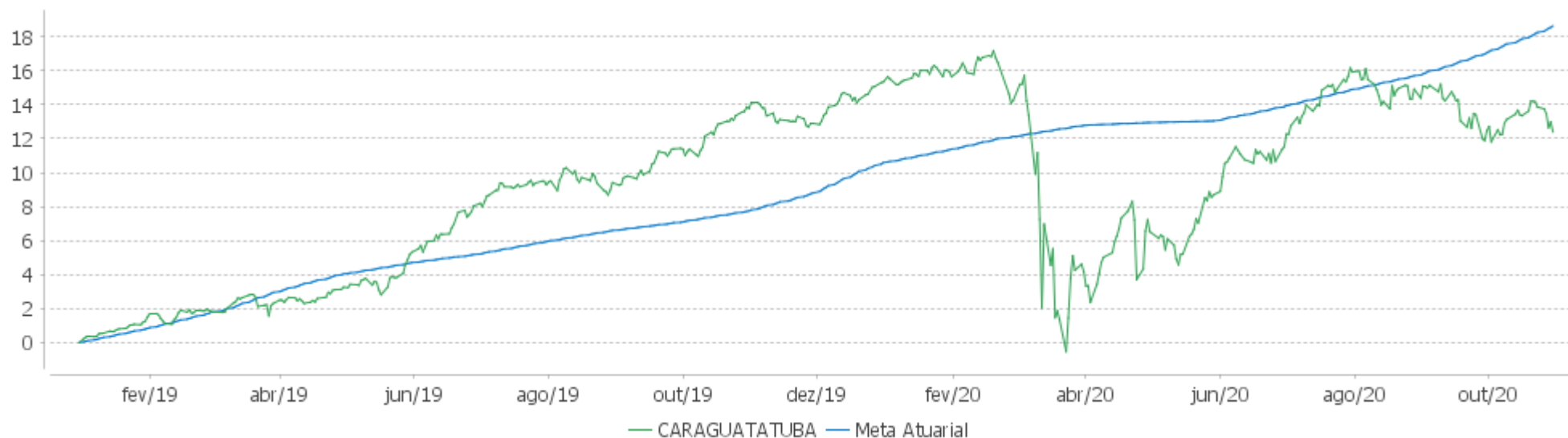
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

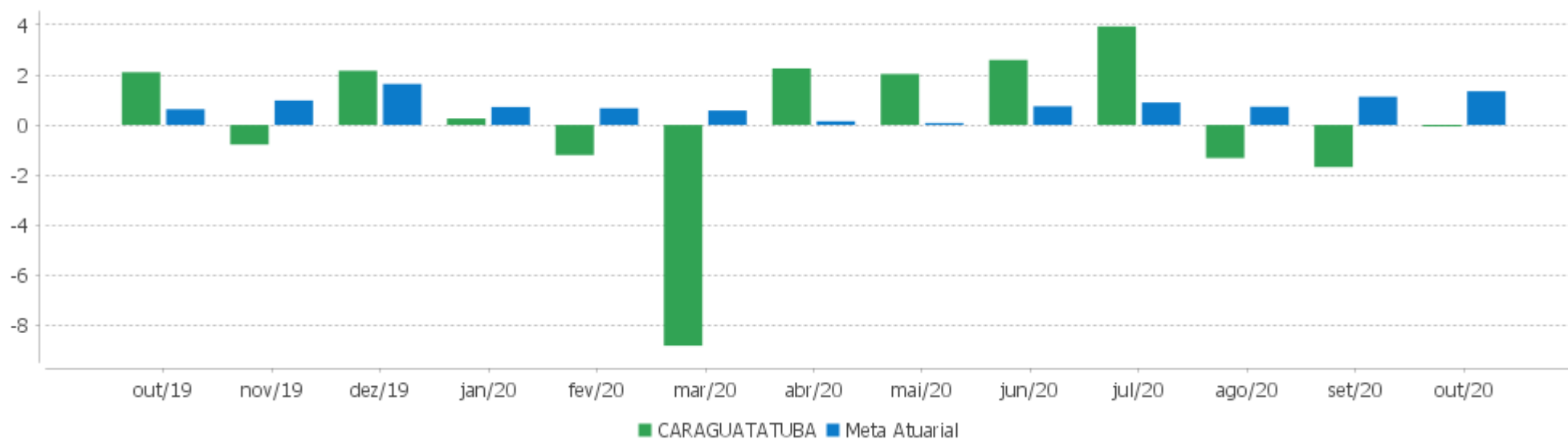
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	50,00	03 meses	-3,04	3,22	-6,25	7,19
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	50,00	06 meses	5,52	4,98	0,54	7,14
			12 meses	-1,21	10,01	-11,22	12,94
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-07	Desde 31/12/2018	12,40	18,53	-6,13	9,78
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	36,83 23.463,53	1.410,48 57.902,08	1.265,63 266.682,17	1.612,44 143.777,42	2.385,87 74.305,10	107.875,83 1.121.940,90	3.074.738,09 18.311.943,42
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,12 -0,05	2,93 -0,35	0,23 -0,20	1,15 -0,23	3,62 -0,44	10,82 -0,66	18,39 -0,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,02	-0,81 -0,30	-3,15 -0,07	4,68 -0,13	-1,41 -0,40	24,69 -0,78	37,24 -1,15
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,11 -0,05	2,94 -0,34	0,24 -0,19	1,13 -0,25	3,67 -0,39	10,79 -0,70	18,38 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,36 -0,03	4,04 -0,23	-1,73 -0,10	1,50 -0,14	4,16 -0,28	19,08 -0,70	30,28 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,22 -0,00	-4,61 -0,27	-5,99 -0,06	4,76 -0,14	-6,25 -0,40	27,85 -1,13	41,32 -1,69
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,21 -0,01	-4,69 -0,35	-5,96 -0,04	4,68 -0,22	-6,23 -0,37	27,83 -1,15	40,92 -2,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,56 0,05	4,57 -0,19	-2,69 -0,06	1,65 -0,09	4,41 -0,22	22,74 -0,67	35,49 -0,71
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18 -0,03	-0,73 -0,22	-3,15 -0,08	4,61 -0,21	-1,25 -0,25	24,65 -0,82	36,83 -1,56
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 0,28	3,15 3,66	1,16 4,23	3,77 -1,05	4,54 5,55	15,45 -10,01	26,10 -12,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,11 -0,97	4,42 2,20	-1,16 -2,91	1,94 -0,06	4,51 0,59	23,65 17,10	32,48 21,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,15 0,12	5,00 -0,45	0,98 -0,11	4,98 0,13	6,16 -0,57	18,25 -1,35	29,01 -2,25
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,31 0,01	3,99 -0,28	-1,76 -0,13	1,49 -0,15	4,12 -0,31	19,16 -0,62	30,15 -0,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-0,73 -0,23	-3,19 -0,11	4,62 -0,19	-1,29 -0,28	24,83 -0,64	37,31 -1,07
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,20 -0,02	-4,62 -0,28	-6,05 -0,12	4,65 -0,25	-6,05 -0,20	28,32 -0,66	41,82 -1,20
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,02	-0,98 -0,47	-3,15 -0,08	4,64 -0,18	-1,52 -0,52	24,50 -0,97	36,94 -1,44
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,15	2,18	0,45	1,19	2,87	9,11	16,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	94,82	89,48	94,17	106,49	89,40	94,74	95,91
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-0,00	0,38	-3,55	4,37	-0,41	28,07	40,76
% do CDI	-0,32	15,71	-748,56	389,24	-12,91	291,97	242,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,12	1,89	0,26	1,09	2,56	8,75	15,66
% do CDI	76,62	77,49	55,37	96,90	79,77	91,05	93,26
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,08	2,55	-0,28	1,25	3,26	17,36	25,35
Var. IPCA p.p.	-0,78	0,33	-2,03	-0,74	-0,66	10,81	13,94
BRADESCO F I A SELECTION	3,33	-17,49	-0,65	28,48	-12,83	6,67	36,20
Var. IBOVESPA p.p.	4,02	1,27	8,06	11,78	-0,46	-0,80	9,76
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-1,78	-13,20	-7,04	20,27	-3,69	23,76	48,94
Var. IBOVESPA p.p.	-1,09	5,56	1,67	3,57	8,68	16,29	22,50
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-1,78	-16,91	-9,22	15,64	-4,71	39,27	49,68
Var. IBOVESPA p.p.	-1,10	1,85	-0,52	-1,06	7,66	31,80	23,24
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	0,50	-20,29	-4,68	18,03	-12,18	19,23	43,68
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-1,33	-17,14	-8,38	16,50	-9,12	15,39	32,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,64	1,62	0,32	-0,20	3,26	7,92	6,14
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,05	-17,54	-8,51	11,41	-10,04	27,58	34,92
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,60	3,02	0,13	0,08	0,54	3,08	3,96
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-1,45	-24,73	-9,28	8,19	-18,47	2,43	13,58
Var. IBOVESPA p.p.	-0,77	-5,97	-0,58	-8,51	-6,10	-5,04	-12,86
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,46	-16,71	-8,84	13,66	-5,27	30,39	57,34
Var. IBOVESPA p.p.	-1,78	2,05	-0,13	-3,04	7,10	22,92	30,91
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-0,82	-18,46	-8,89	16,42	-11,42	11,13	26,93
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	0,30	-0,19	-0,29	0,95	3,66	0,49
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,77	50,05	10,87	21,16	60,56	94,90	135,92
Var. IBOVESPA p.p.	-1,08	68,81	19,57	4,46	72,93	87,43	109,48
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
182	01/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.477.542,97521400	2,7071970610
195	02/10/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.000.000,00	0,00	776.681,53494018	5,1501160000
183	06/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.232,22	0,00	3.413,46692600	2,7046460970
181	07/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	291.087,62	0,00	107.608,17670500	2,7050697160
184	08/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.735,88	0,00	641,31061400	2,7067694810
190	08/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	8.134,92	0,00	2,56099861	3.176,4640390000
196	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	44.000,00	11.840,83545000	3,7159540000
191	16/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	23.140,45	0,00	7,28190393	3.177,8021560000
185	19/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	237.376,18	0,00	87.613,35126500	2,7093608060
186	19/10/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.655,70	0,00	611,10354700	2,7093608060
188	19/10/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.403.814,46	0,00	41.847,93360443	33,5456100000
187	27/10/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.270.590,25	67.635,96022788	33,5707550000
192	27/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,31718770	3.179,3567860000
193	27/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	107.699,72	0,00	33,87468826	3.179,3567860000
197	27/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	144.627,23	38.879,11312800	3,7199210000
189	28/10/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	3.899.374,65	0,00	116.134,96517015	33,5762330000
194	28/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.264,23	0,00	0,39760994	3.179,5734240000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,03	-0,00	-0,19	0,15	5.972.798,89	1,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,17	0,00	-0,07	0,11	7.882.494,92	1,63
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,71	0,18	-0,00	-0,06	0,12	8.917.363,02	1,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,72	0,33	0,03	-0,11	0,08	50.367.792,03	10,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,72	0,13	0,00	-0,05	0,12	1.516.500,08	0,31
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,00	0,89	0,00	0,17	0,49	463.036,62	0,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,08	0,02	-0,00	0,15	15.748.092,46	3,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,11	-0,11	-0,11	50.847.231,45	10,52
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	1,36	0,01	-0,17	-0,36	4.886.294,70	1,01
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,06	1,36	0,04	-0,15	-0,31	16.127.619,85	3,34
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,54	2,04	0,12	-0,16	-0,56	33.346.876,69	6,90
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,72	3,14	0,09	0,01	0,18	15.896.995,32	3,29
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,72	3,15	0,02	0,01	0,19	4.248.162,76	0,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,73	3,16	0,25	0,01	0,19	43.247.136,95	8,95
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	3,15	0,09	0,01	0,20	15.516.886,55	3,21
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,63	3,35	0,25	-0,03	-0,00	40.810.801,06	8,44
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,89	4,87	0,04	0,01	0,21	4.088.950,92	0,85
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,96	4,93	0,22	0,01	0,20	24.116.097,70	4,99
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,98	4,93	0,46	0,01	0,22	50.605.189,83	10,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,87	9,39	0,02	-0,08	-1,45	1.306.254,86	0,27
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,03	9,83	0,19	-0,00	0,05	11.109.429,19	2,30
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,24	9,95	0,10	-0,12	-2,46	5.708.399,87	1,18
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,90	11,78	0,13	-0,09	-1,78	6.474.030,26	1,34
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,66	10,26	0,10	0,02	0,50	5.299.905,97	1,10
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	22,99	11,13	0,21	-0,08	-1,78	10.227.117,71	2,12
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	23,11	11,02	0,28	-0,06	-1,33	13.606.974,13	2,81
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	24,72	10,79	0,10	0,13	3,33	5.146.342,28	1,06
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,43	10,36	0,38	-0,04	-0,82	20.383.712,14	4,22
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	28,05	13,17	0,02	-0,07	-1,77	8.167.572,62	1,69
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	108,63	12,57	-0,01	0,34	36,83	1.425.440,09	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS