



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
NOVEMBRO 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 08.12.2020.

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

79,87%

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	6,08	0,34	4,35	16.182.801,52	3,22	4.734.232.270,41	0,34
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,57	0,19	3,13	10.894.208,65	2,17	245.724.849,61	4,43
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,74	1,96	1,22	16.209.206,89	3,23	380.050.993,13	4,27
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,20	3,15	5.484.725,87	1,09	7.844.641.875,20	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	-0,26	15.826.160,31	3,15	5.721.224.105,90	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	1,17	44.107.098,27	8,79	5.938.047.265,27	0,74
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,73	2,49	-2,25	24.717.583,55	4,93	1.790.167.818,44	1,38
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,83	1,98	0,30	4.332.208,76	0,86	1.200.450.883,37	0,36
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	19,68	2,55	-2,26	4.193.046,48	0,84	82.072.573,20	5,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,84	2,57	-2,17	51.903.399,29	10,34	1.749.025.544,15	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	9,01	0,43	5,03	33.491.433,43	6,67	2.828.341.630,94	1,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	6,28	15.939.889,38	3,18	10.336.804.140,67	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	0,33	4,38	4.902.444,15	0,98	5.838.093.192,79	0,08
BB	BB	BB PREV RF VII	2,42	1,17	4,35	468.448,42	0,09	242.932.832,47	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	51.264.169,47	10,22	14.161.450.965,39	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,79	1,50	1,35	299.916.824,44	59,76		

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	2,33	6.113.638,08	1,22	953.167.388,81	0,64
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,60	2,08	2,47	41.658.817,51	8,30	658.698.123,27	6,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	0,15	2,05	1.315.764,17	0,26	4.499.544.566,86	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	0,10	2,65	50.420.466,70	10,05	4.356.779.873,38	1,16
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,45	0,92	2,37	99.508.686,46	19,83		
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	241,06	-0,17	1.419,30	1.413.904,35	0,28	56.027.774,26	2,52
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			241,06	-0,17	1.407,88	1.413.904,35	0,28		
Renda Fixa			8,95	1,35	1,90	400.839.415,25	79,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,86%

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	45,29	15,33	-5,95	23.509.393,35	4,68	1.059.305.047,31	2,22
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,29	15,33	-5,95	23.509.393,35	4,68		

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	44,33	8,19	-10,73	5.568.064,27	1,11	767.879.921,64	0,73
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,19	13,62	-14,49	1.484.103,98	0,30	984.415.780,43	0,15
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,16	8,45	-9,67	6.190.830,95	1,23	2.027.456.710,01	0,31
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,57	13,75	-5,74	15.478.110,98	3,08	902.308.762,46	1,72
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	42,03	12,96	-6,14	7.313.300,21	1,46	686.938.519,27	1,06
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,86	14,26	-5,78	12.693.697,50	2,53	912.327.763,54	1,39
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,54	11,84	-4,68	11.438.504,53	2,28	2.046.261.864,71	0,56
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,20	12,28	-10,51	5.950.624,19	1,19	3.450.221.666,13	0,17
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,03	12,29	-7,29	66.117.236,61	13,17		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			42,84	13,08	-7,06	89.626.629,96	17,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,27%

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	29,44	2,43	7,93	11.384.492,68	2,27	1.959.218.771,54	0,58
Sub-total Artigo 9º A, III			29,44	2,43	7,93	11.384.492,68	2,27		
Investimentos no Exterior			24,89	2,43	7,93	11.384.492,68	2,27		
Total			13,02	3,29	0,66	501.850.537,89	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	299.916.824,44	59,76	10,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.508.686,46	19,83	1,00	19,50	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.413.904,35	0,28	0,01	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	400.839.415,25	79,87				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	23.509.393,35	4,68	3,00	5,00	10,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	66.117.236,61	13,17	10,00	15,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	89.626.629,96	17,86				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	11.384.492,68	2,27	0,00	5,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.384.492,68	2,27				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

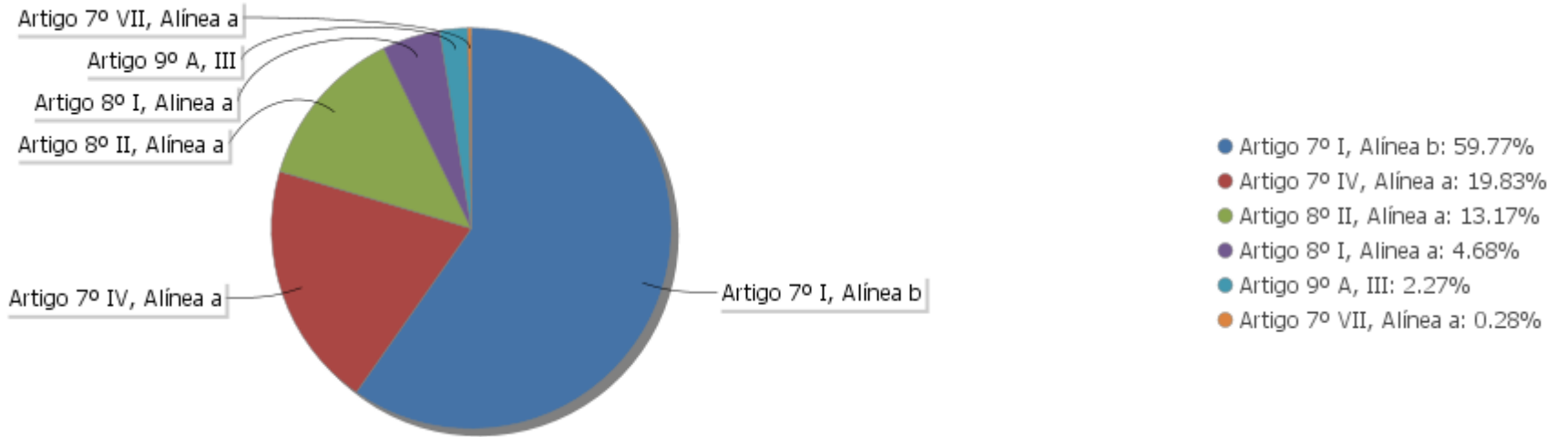
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,50 1.006,20	1,35 52,05	0,18 37,97	3,69 356,58	2,65 89,08	4.430.496,75	3.436.748,45
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,92 618,20	2,37 91,71	0,16 35,07	2,49 240,50	3,41 114,82	911.973,76	2.452.400,87
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,17 -115,02	1.407,88 54.377,16	37,42 8.061,85	1.449,71 140.149,00	1.434,67 48.248,59	-2.376,74	1.369.001,66
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,33 -0,57	-5,95 -0,11	8,62 -0,96	24,08 -0,51	1,16 0,55	3.125.681,21	-1.487.514,69
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,29 -3,61	-7,29 -1,45	6,74 -2,84	22,46 -2,13	1,24 0,63	7.238.782,34	-2.913.665,90
Artigo 9º A, III % do CDI	2,43 1.625,60	7,93 2.356,65				216.920,06	384.492,68
CARAGUATATUBA (Total)						15.921.477,38	3.241.463,07

Análise de Liquidez

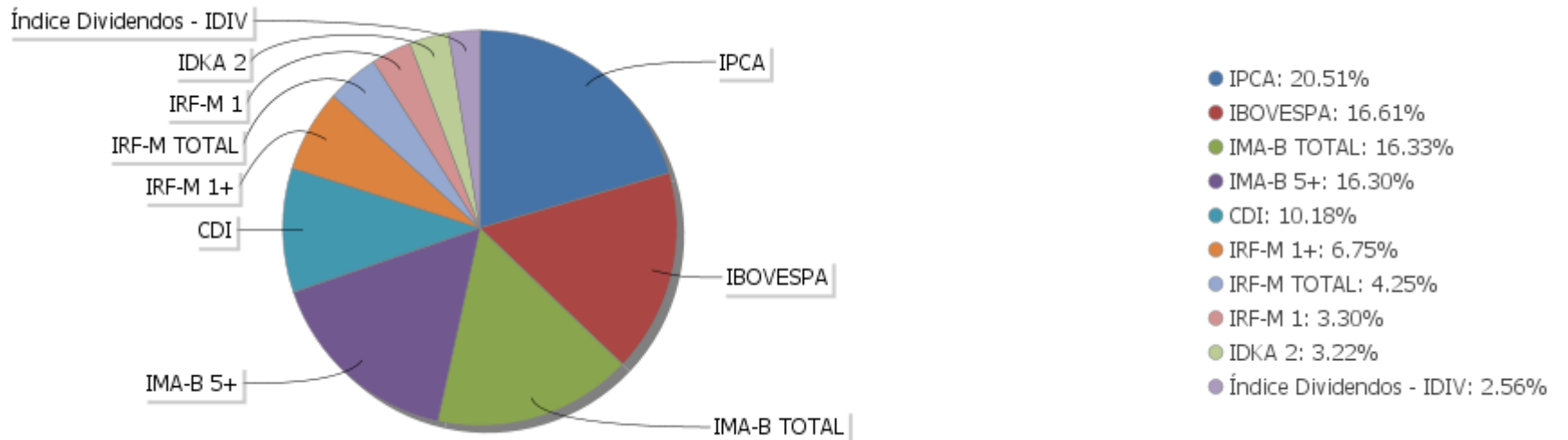
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	462.572.058,69	92,17	462.572.058,69	92,17
de 31 a 364 dias	37.396.126,43	7,45	499.968.185,12	99,62
acima de 365 dias	1.882.352,77	0,38	501.850.537,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

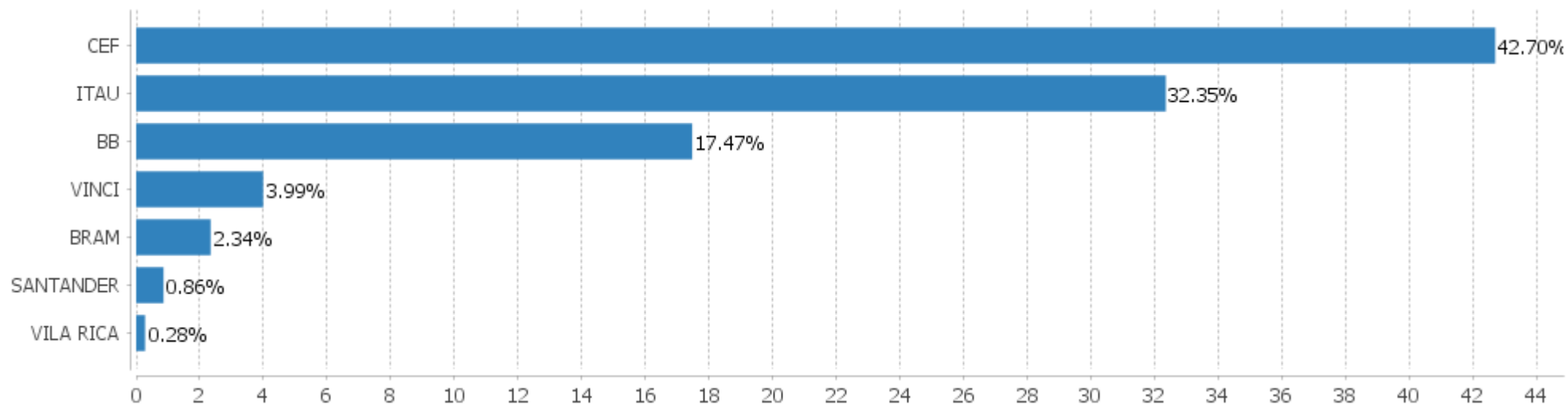


Alocação Por Estratégia



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	3,29		0,66
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	0,83		8,07
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	2,46		-7,41
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

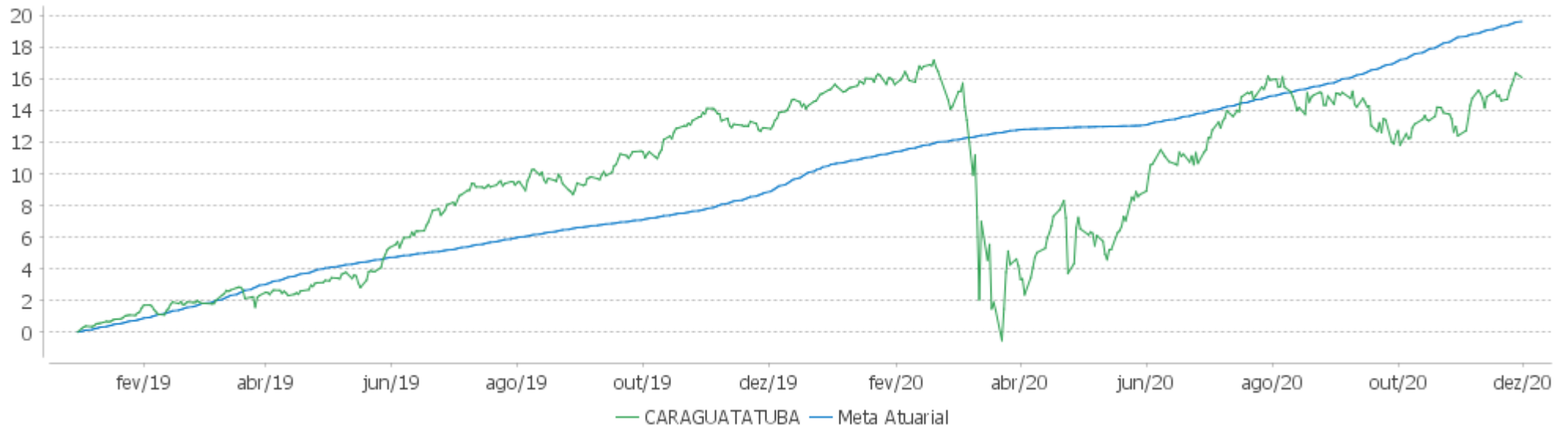
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

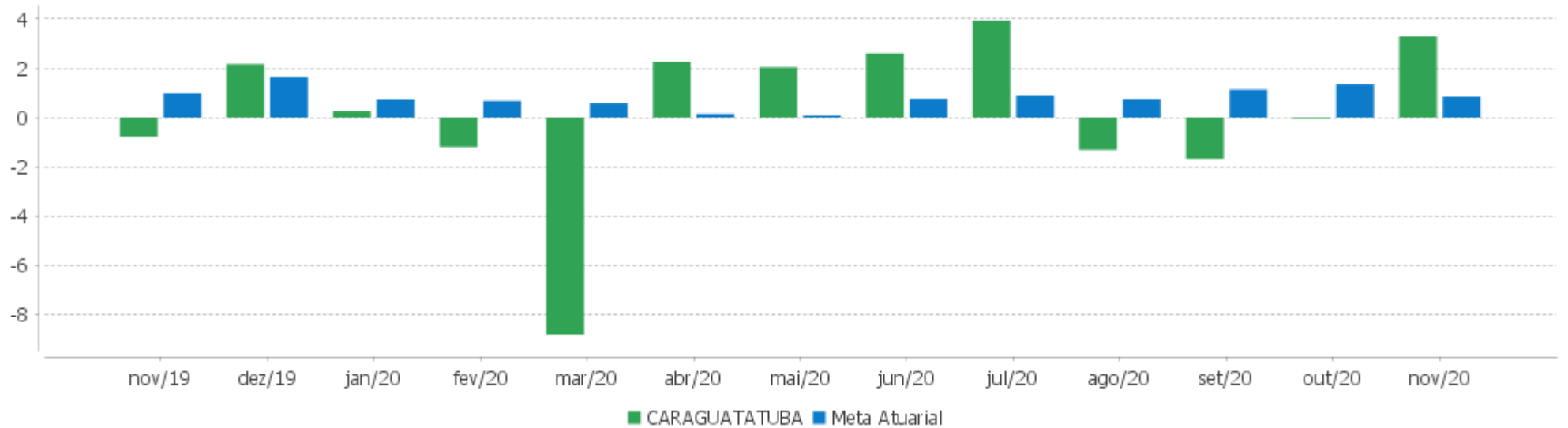
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	52,17	03 meses	1,49	3,33	-1,83	6,98
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	47,83	06 meses	6,81	5,77	1,04	6,71
			12 meses	2,84	9,85	-7,01	13,02
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03	Desde 31/12/2018	16,10	19,52	-3,41	9,65

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 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,04	3,13 -0,40	0,31 -0,23	0,93 -0,25	3,53 -0,42	10,45 -0,68	17,89 -1,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,17 -0,32	0,62 -0,05	5,19 -0,12	3,18 -0,34	26,04 -0,79	41,07 -1,17
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,03	3,15 -0,38	0,35 -0,19	0,93 -0,25	3,56 -0,40	10,43 -0,70	17,92 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,33 -0,03	4,38 -0,27	-0,64 -0,11	0,43 -0,15	5,02 -0,28	18,30 -0,74	30,60 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,57 -0,02	-2,17 -0,29	0,07 -0,07	6,38 -0,14	0,33 -0,35	29,21 -1,12	47,03 -1,76
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,55 -0,04	-2,26 -0,39	0,08 -0,06	6,37 -0,16	0,26 -0,43	29,18 -1,15	46,61 -2,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	0,43 -0,03	5,03 -0,22	-1,11 -0,05	0,20 -0,09	5,76 -0,24	21,83 -0,72	36,19 -0,76
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,96 -0,04	1,22 -0,26	0,57 -0,10	5,12 -0,19	3,23 -0,28	26,06 -0,77	40,62 -1,61
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,17 -0,83	4,35 2,87	1,86 1,19	3,69 -1,62	5,31 1,79	16,61 -10,22	27,51 -14,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 0,45	5,27 2,68	0,20 -1,68	1,37 -1,39	5,90 2,13	24,20 17,03	33,20 21,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,03	6,28 -0,49	1,41 0,10	4,27 -0,06	7,44 -0,61	19,53 -1,35	30,28 -2,28
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,34 -0,02	4,35 -0,30	-0,63 -0,10	0,45 -0,13	4,98 -0,32	18,41 -0,63	30,51 -0,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,24 -0,24	0,60 -0,07	5,13 -0,18	3,24 -0,27	26,17 -0,66	41,14 -1,09
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,49 -0,09	-2,25 -0,37	-0,01 -0,15	6,20 -0,33	0,41 -0,27	29,47 -0,86	47,47 -1,33
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,98 -0,02	0,98 -0,50	0,60 -0,07	5,13 -0,18	2,98 -0,54	25,84 -0,99	40,74 -1,49
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,15 100,31	2,33 90,10	0,44 94,41	1,10 106,06	2,67 89,80	8,75 94,69	15,63 95,85
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,08	2,47	0,37	4,87	4,56	29,76	44,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	1.390,00	95,35	80,73	470,51	153,51	322,06	275,09
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,15 103,54	2,05 79,00	0,27 58,73	0,91 88,15	2,40 80,86	8,40 90,87	15,20 93,21
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,10 -0,27	2,65 0,06	-0,05 -1,93	0,82 -1,94	3,01 -0,77	16,62 9,45	25,32 13,81
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,17 -115,02	1.419,30 54.818,08	38,46 8.286,00	1.461,44 141.283,24	1.446,29 48.639,34	84.003,00 909.142,03	3.100.522,88 19.015.193,95
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	8,19 -7,71	-10,73 -4,89	8,74 -0,85	28,88 4,29	-4,31 -4,92	14,22 -7,45	51,90 0,60
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	11,84 -4,06	-2,92 2,92	5,46 -4,12	26,78 2,20	6,26 5,65	34,60 12,94	72,69 21,39
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	12,96 -2,94	-6,14 -0,30	7,73 -1,85	22,05 -2,54	5,33 4,72	48,18 26,52	76,22 24,92
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,28	-10,51	7,24	25,78	-3,23	29,97	67,60
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	13,75 -2,15	-5,74 0,10	7,45 -2,13	22,78 -1,81	2,05 1,44	27,36 5,70	56,34 5,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	14,26 -0,14	-5,78 3,34	8,69 -1,13	18,42 -2,89	2,25 2,30	38,18 5,41	59,11 -1,41
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	13,62 -2,29	-14,49 -8,65	6,71 -2,88	17,29 -7,30	-7,46 -8,07	10,30 -11,36	35,23 -16,08
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,45 -7,45	-9,67 -3,83	0,45 -9,13	16,10 -8,49	-0,25 -0,86	36,82 15,16	73,99 22,69
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	15,33 -0,57	-5,95 -0,11	8,62 -0,96	24,08 -0,51	1,16 0,55	24,84 3,18	51,42 0,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,43 -13,47	53,70 59,54	-1,39 -10,98	20,74 -3,84	50,99 50,38	90,52 68,85	137,19 85,89
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 6% p.p.	3,29 2,45	0,66 -7,51	1,49 -1,86	6,81 0,99	2,84 -7,11		
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	0,85	8,96	3,63	6,36	10,83	21,43	33,24
IPCA + 6%	0,84	8,17	3,35	5,82	9,95	20,36	32,69

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,37	2,59	1,88	2,76	3,77	7,17	11,51
INPC	0,38	3,34	2,15	3,28	4,60	8,13	11,97
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

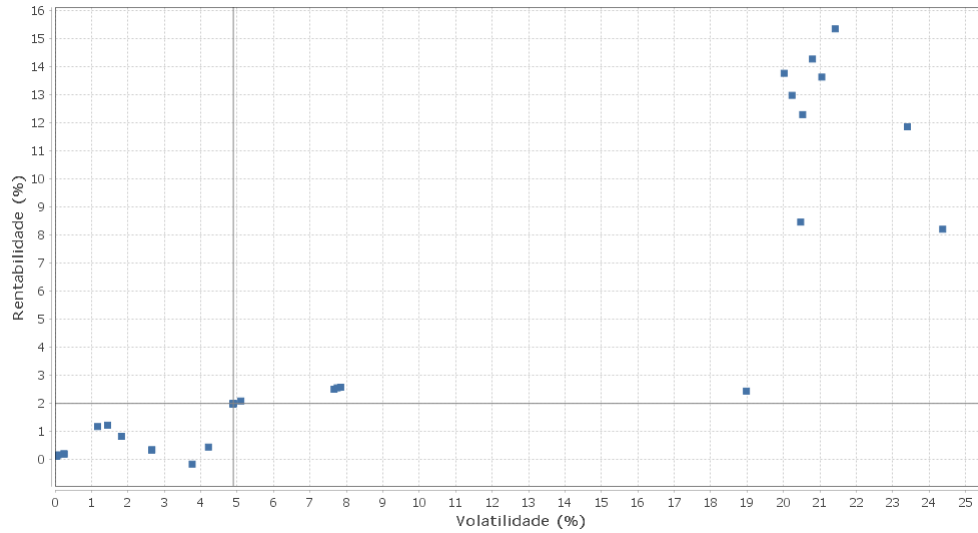
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
205	06/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.232,22	0,00	3.402,67146200	2,7132269750
211	06/11/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	20.408,22	607,49270834	33,5941810000
213	06/11/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	9.159,00	0,00	2,87926634	3.181,0186720000
202	09/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	338.442,79	0,00	124.704,49531200	2,7139582190
200	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	44.000,00	11.820,72150900	3,7222770000
206	10/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.655,70	0,00	610,02777300	2,7141387180
209	10/11/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.395.222,97	0,00	41.506,15756260	33,6148430000
203	11/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.000.000,00	368.526,51497000	2,7135089590
198	12/11/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	193.599,93464066	5,1652910000
207	18/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	237.376,18	0,00	87.420,40569500	2,7153406360
208	19/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.735,88	0,00	639,22538800	2,7155992720
204	24/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.000.000,00	736.608,52813300	2,7151464090
199	25/11/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	385.442,97515723	5,1888350000
214	26/11/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	107.699,72	0,00	33,82351335	3.184,1671470000
201	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	159.028,19	42.685,02682600	3,7256200000
212	27/11/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.379.318,16	70.726,72440295	33,6410060000
215	27/11/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,31023238	3.184,4872330000
210	30/11/2020	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.963.958,59	0,00	88.084,94211455	33,6488680000
216	30/11/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.264,23	0,00	0,39695651	3.184,8072890000
Total						

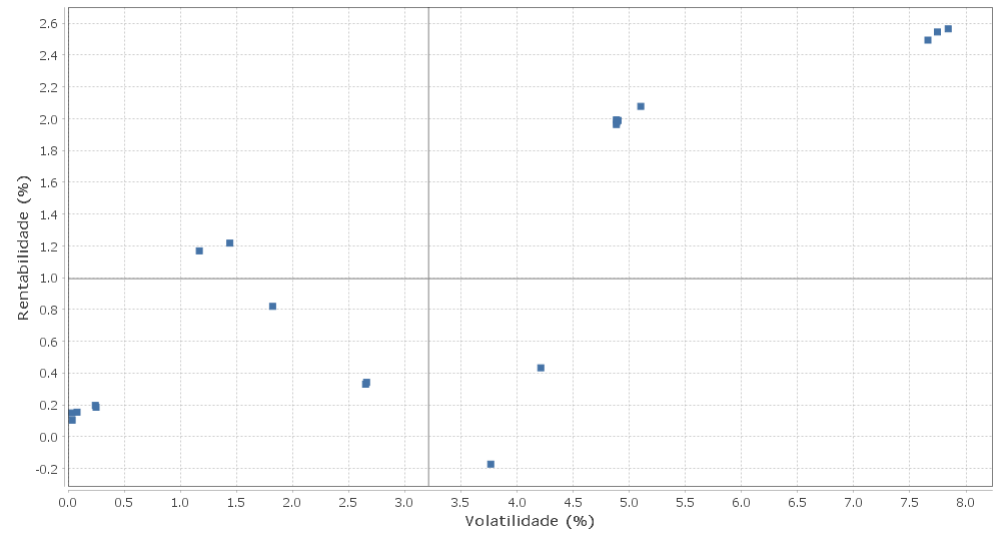
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

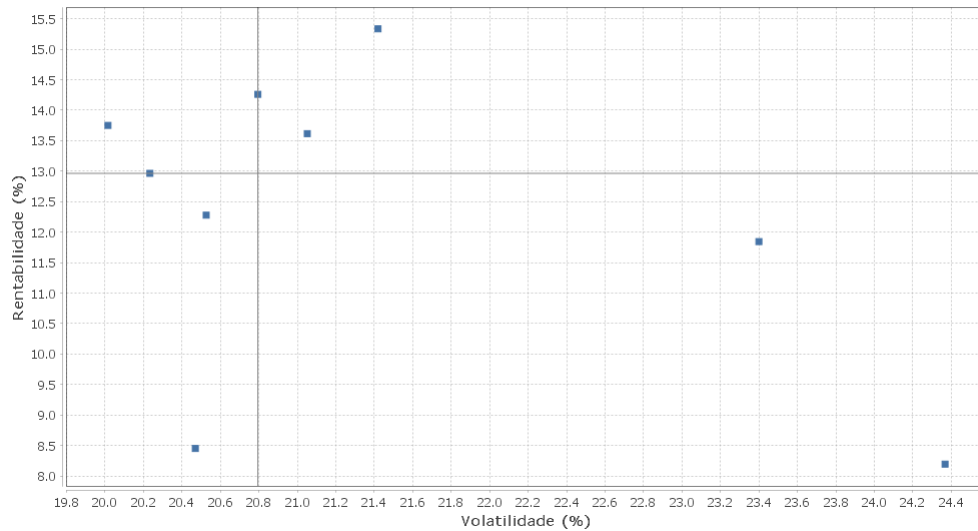
CARAGUATATUBA - No Mês



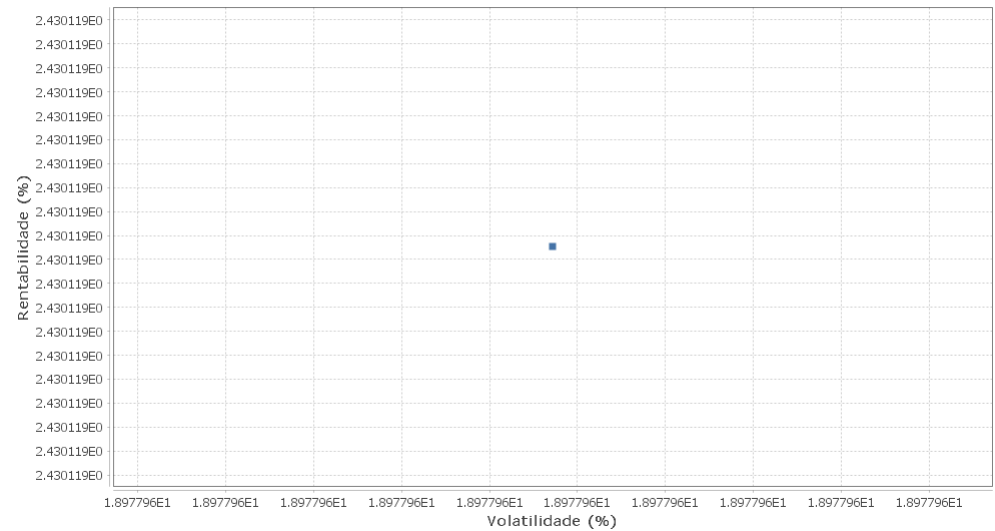
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 15.832.945,98

Value-At-Risk: 3,15%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,03	-0,00	0,01	0,15	6.113.638,08	1,22
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,30	0,02	-1,23	0,10	50.420.466,70	10,05
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,13	0,00	0,07	0,15	1.315.764,17	0,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,17	0,00	0,20	0,20	5.484.725,87	1,09
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,25	0,18	-0,00	0,15	0,19	10.894.208,65	2,17
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	0,90	0,00	0,87	1,17	468.448,42	0,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,02	0,74	1,22	15.939.889,38	3,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,11	0,37	0,82	51.264.169,47	10,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,65	1,34	0,01	0,07	0,33	4.902.444,15	0,98
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,66	1,34	0,04	0,07	0,34	16.182.801,52	3,22
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	3,77	12,00	-0,01	-0,09	-0,17	1.413.904,35	0,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,21	2,01	0,11	0,07	0,43	33.491.433,43	6,67
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	2,66	0,07	0,37	1,96	16.209.206,89	3,23
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,07	0,38	1,99	15.826.160,31	3,15
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,02	0,37	1,98	4.332.208,76	0,86
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,20	0,38	1,99	44.107.098,27	8,79
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,10	2,86	0,21	0,38	2,08	41.658.817,51	8,30
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,66	4,12	0,17	0,31	2,49	24.717.583,55	4,93
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,75	4,15	0,03	0,31	2,55	4.193.046,48	0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,84	4,17	0,37	0,31	2,57	51.903.399,29	10,34
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	18,98	12,80	0,04	0,12	2,43	11.384.492,68	2,27
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	20,01	9,78	0,28	0,68	13,75	15.478.110,98	3,08
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,23	11,79	0,15	0,63	12,96	7.313.300,21	1,46
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,47	11,01	0,12	0,41	8,45	6.190.830,95	1,23
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	20,53	10,21	0,11	0,59	12,28	5.950.624,19	1,19
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,79	9,69	0,21	0,68	14,26	12.693.697,50	2,53
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,05	9,69	0,03	0,64	13,62	1.484.103,98	0,30
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,42	10,42	0,43	0,71	15,33	23.509.393,35	4,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,40	11,81	0,24	0,50	11,84	11.438.504,53	2,28
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	24,37	10,95	0,10	0,33	8,19	5.568.064,27	1,11