



CUBATÃO
JANEIRO 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 26.05.2020.

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

83,11%

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	4,90	0,25	0,25	20.015.661,77	2,56	196.502.473,72	10,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,89	0,24	0,24	28.018.487,61	3,59	379.812.548,39	7,38
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,42	0,42	89.759.927,77	11,49	7.374.284.212,96	1,22
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,48	0,32	0,32	57.913.024,43	7,41	1.475.235.325,58	3,93
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,26	0,26	29.721.046,67	3,81	6.477.324.446,92	0,46
BRAM	BRASESCO	BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	4,90	0,24	0,24	31.037.904,88	3,97	736.673.993,30	4,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,25	0,25	60.443.703,45	7,74	6.604.088.892,56	0,92
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,25	0,40	0,40	18.638.033,94	2,39	164.899.848,61	11,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,42	0,42	42.809.011,25	5,48	10.529.932.746,92	0,41
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,25	0,42	0,42	997.766,36	0,13	752.613.419,69	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,05	0,49	0,49	15.392.118,02	1,97	1.449.564.546,60	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,03	0,33	0,33	394.746.686,15	50,54		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	4,88	0,23	0,23	32.345.987,04	4,14	3.029.770.455,34	1,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,88	0,23	0,23	32.345.987,04	4,14		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,07	0,37	0,37	47.792.478,59	6,12	4.320.739.663,56	1,11
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,37	0,37	12.990.605,72	1,66	4.996.174.196,71	0,26
CEF	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	1,87	0,54	0,54	16.738.148,15	2,14	311.986.935,57	5,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,20	0,57	0,57	65.530.442,48	8,39	943.468.226,26	6,95
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,01	0,27	0,27	32.275.602,50	4,13	1.952.250.666,57	1,65
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,89	0,26	0,26	38.673.995,69	4,95	1.618.694.263,00	2,39
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,13	0,41	0,41	214.001.273,13	27,40		

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
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	75,35	-37,34	-37,34	3.306,53	0,00	55.010,74	6,01
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			75,35	-37,34	-37,34	3.306,53	0,00		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,08	0,38	0,38	8.088.192,73	1,04	10.413.910.398,38	0,08
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,08	0,38	0,38	8.088.192,73	1,04		
Renda Fixa			2,73	0,35	0,35	649.185.445,58	83,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,89%

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
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	16,45	-1,25	-1,25	22.002.647,48	2,82	348.579.709,27	6,31
BNY MELLON	BNY MELLON	ARX INCOME FIA	17,53	-0,25	-0,25	27.293.854,74	3,49	771.319.000,82	3,54
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,68	0,62	0,62	11.194.682,24	1,43	2.139.496.712,77	0,52
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	15,26	0,69	0,69	15.362.093,18	1,97	155.271.175,25	9,89
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	13,54	-1,16	-1,16	20.860.792,89	2,67	246.644.541,09	8,46
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	18,00	-1,70	-1,70	5.468.976,21	0,70	59.804.793,14	9,14
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,71	0,95	0,95	27.211.873,05	3,48	632.363.480,06	4,30
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,58	-0,20	-0,20	129.394.919,79	16,57		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	19,52	-7,29	-7,66	2.516.250,00	0,32		
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			19,52	-7,29	-7,29	2.516.250,00	0,32		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,31	-0,34	-0,34	131.911.169,79	16,89		
Total						781.096.615,37	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	394.746.686,15	50,54	0,00	40,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	32.345.987,04	4,14	0,00	5,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	214.001.273,13	27,40	0,00	23,85	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.306,53	0,00	0,00	0,05	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.088.192,73	1,04	0,00	1,10	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	649.185.445,58	83,11				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	129.394.919,79	16,57	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.516.250,00	0,32	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	131.911.169,79	16,89				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

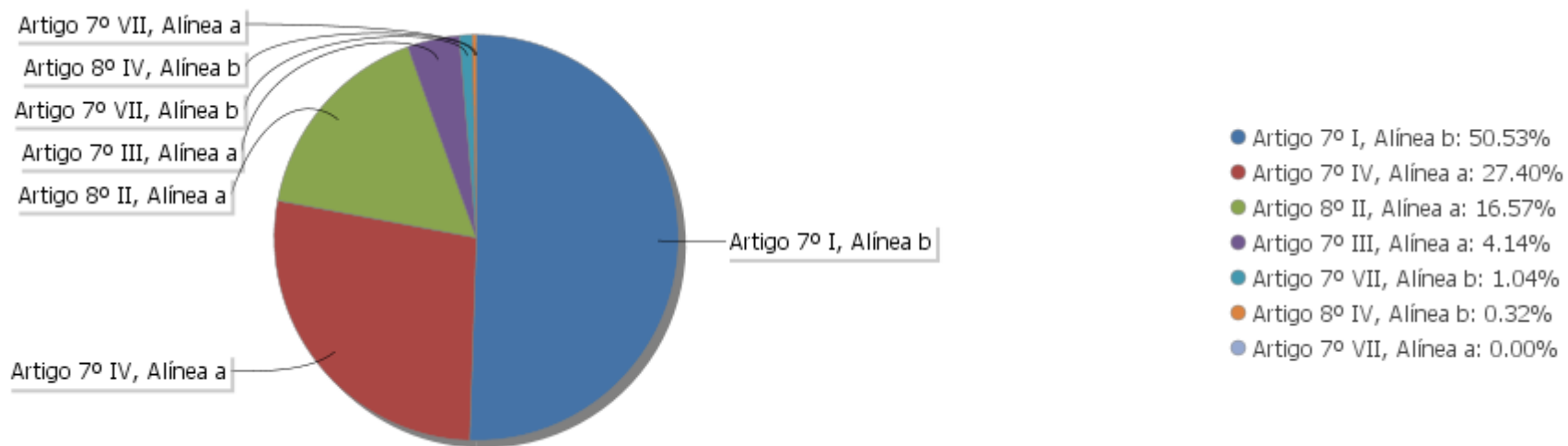
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,33 87,09	0,33 87,09	0,35 30,49	4,50 172,66	13,07 225,98	1.306.899,86	1.306.899,86
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,23 60,93	0,23 60,93	-0,36 -31,74	5,45 209,34	17,66 305,34	74.055,62	74.055,62
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,41 107,75	0,41 107,75	0,65 56,91	4,10 157,56	11,07 191,33	880.574,66	880.574,66
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-37,34 -9.914,57	-37,34 -9.914,57	-62,13 -5.469,50	-61,71 -2.369,60	-63,51 -1.097,99	-1.970,46	-1.970,46
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,38 100,63	0,38 100,63	1,03 90,36	2,39 91,77	5,54 95,73	30.539,52	30.539,52
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,20 1,43	-0,20 1,43	10,11 4,01	17,07 5,34	25,70 8,90	-255.100,88	-255.100,88
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-7,29 -5,66	-7,29 -5,66	2,62 -3,48	6,08 -5,65	20,52 3,72	-197.350,00	-197.350,00
						1.837.648,32	1.837.648,32

Análise de Liquidez

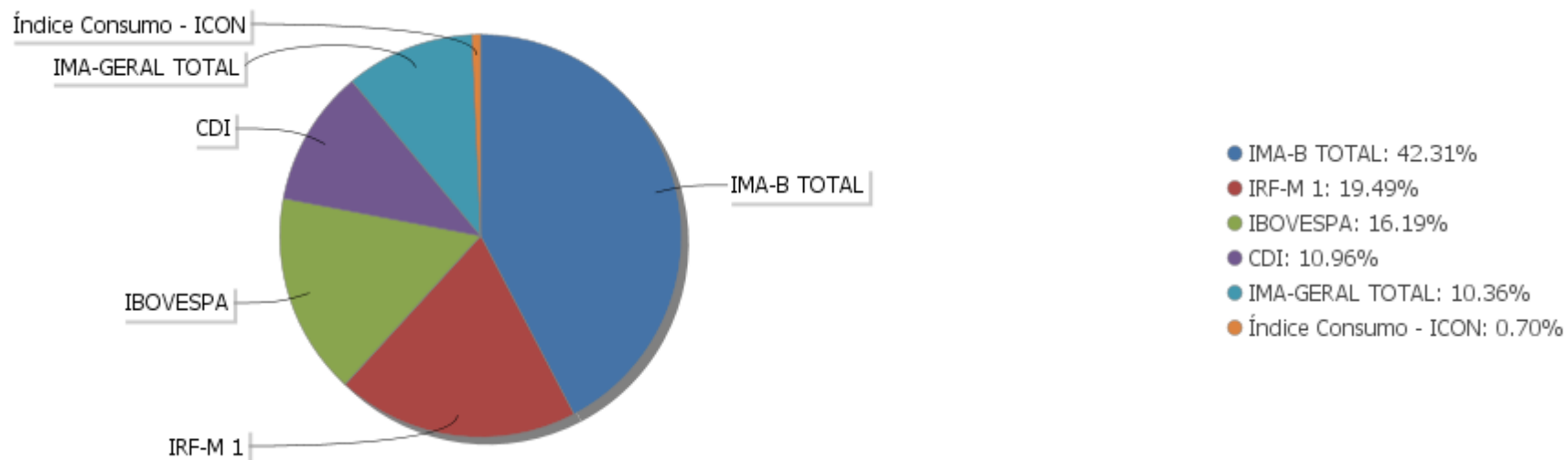
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	781.093.308,84	100,00	781.093.308,84	100,00
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	781.093.308,84	100,00
acima de 365 dias	3.306,53	0,00	781.096.615,37	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

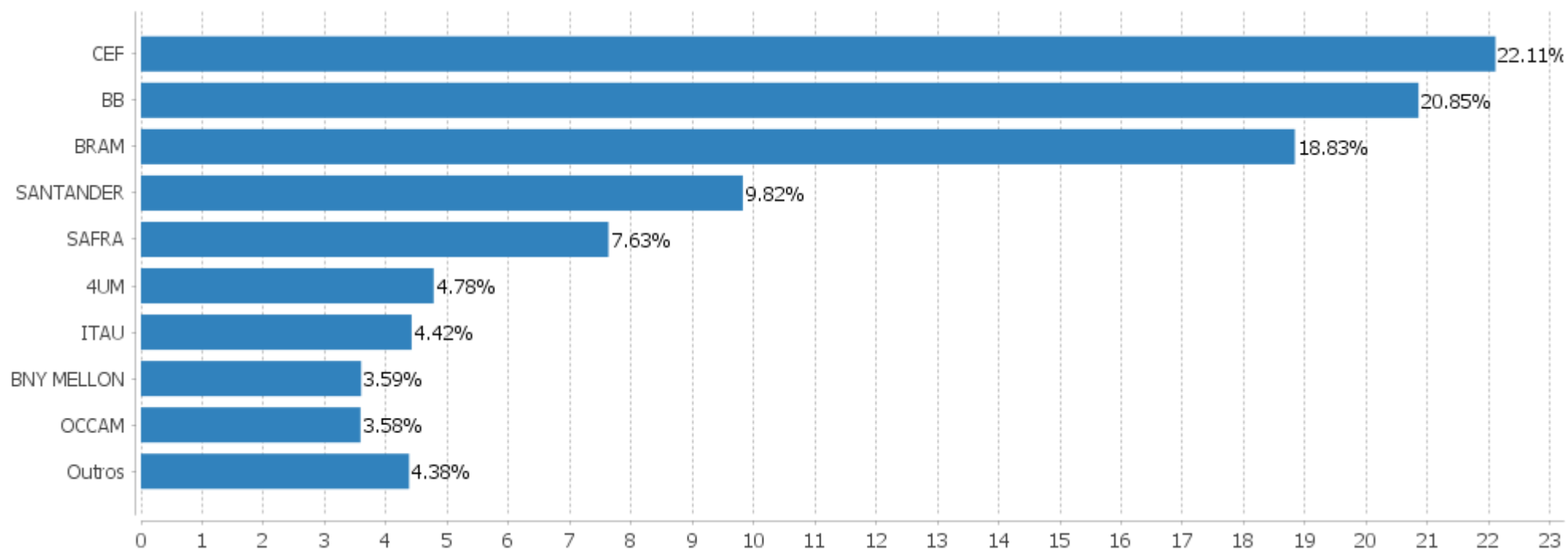


Alocação Por Estratégia



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	0,23												0,23
INPC + 6%	0,70												0,70
p.p. indexador	-0,47												-0,47
2019	3,58	0,24	0,31	1,07	2,11	2,57	1,17	0,27	1,76	2,17	-0,86	2,58	18,27
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,70	-0,76	-0,90	-0,02	1,45	2,12	0,54	-0,36	1,33	1,60	-1,86	0,87	7,49

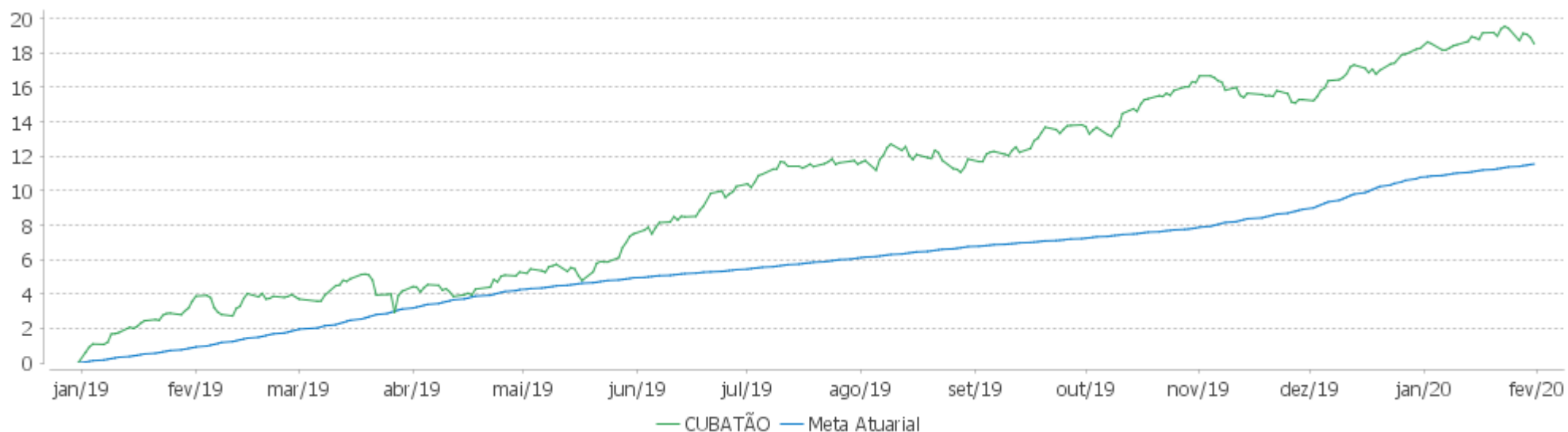
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

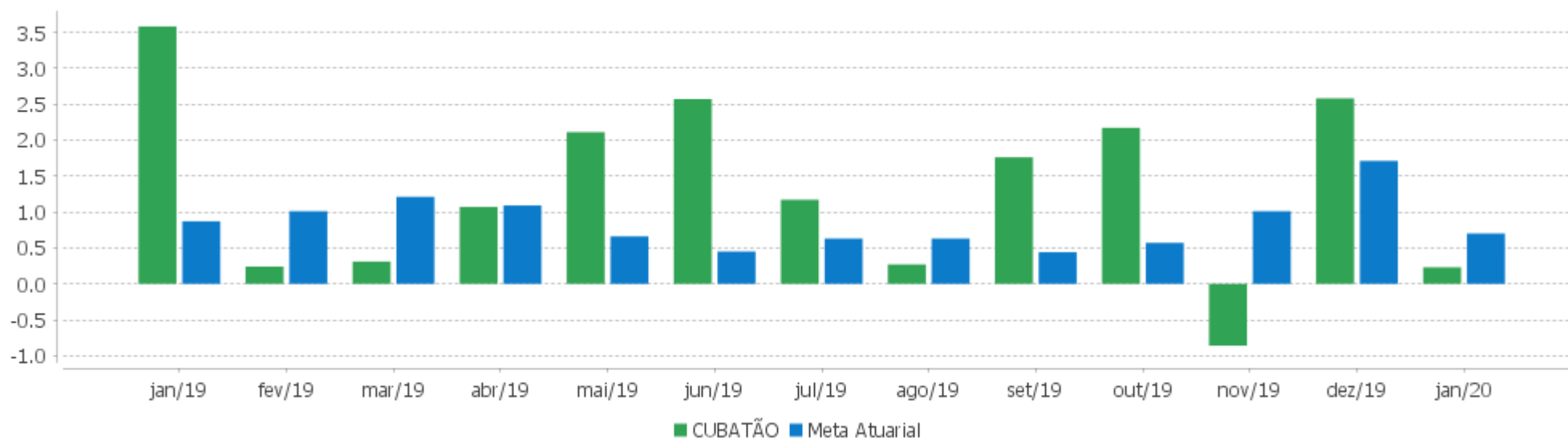
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	53,85	03 meses	1,94	3,46	-1,52	3,51
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	46,15	06 meses	6,28	5,16	1,11	3,78
			12 meses	14,45	10,59	3,86	4,00
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,58	2019-01	Desde 31/12/2018	18,54	11,55	6,99	3,94
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2019-11					

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 TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	-37,34 -9.914,59	-37,34 -9.914,59	-64,25 -5.656,30	-77,97 -2.993,94	-89,55 -1.548,09	-96,42 -769,40	-97,62 -422,80
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	0,54 142,53	0,54 142,53	1,34 117,57	4,79 183,74	11,38 196,70	19,85 158,37	33,65 145,74
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,27 0,01	0,27 0,01	-0,33 -0,09	5,66 0,02	17,92 -0,19	34,49 -0,30	54,10 -0,22
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,37 98,23	0,37 98,23	1,07 94,62	2,51 96,33	5,66 97,86	12,30 98,18	23,30 100,90
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 0,00	0,26 0,00	-0,27 -0,03	5,54 -0,10	17,77 -0,35	34,16 -0,63	53,49 -0,83
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,57 0,01	0,57 0,01	0,69 -0,05	4,06 -0,07	11,37 0,05	22,72 0,04	38,62 0,28
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,37 99,51	0,37 99,51	1,06 93,34	2,46 94,35	5,63 97,34	12,30 98,14	23,07 99,93
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23 -0,03	0,23 -0,03	-0,36 -0,12	5,45 -0,19	17,66 -0,45	34,19 -0,59	52,87 -1,45
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,38 100,63	0,38 100,63	1,03 90,36	2,39 91,77	5,54 95,73	12,20 97,38	23,07 99,92
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,36 -0,12	5,44 -0,20	17,72 -0,40	34,14 -0,64	53,25 -1,07
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,02	0,24 -0,02	-0,29 -0,05	5,52 -0,13	17,77 -0,34	33,68 -1,10	52,36 -1,96
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,03	0,42 -0,03	1,13 -0,07	2,90 -0,14	6,33 -0,28	13,46 -0,58	25,00 -0,84
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,13 -0,07	2,89 -0,15	6,33 -0,29	13,50 -0,54	24,99 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,14 -0,05	2,93 -0,11	6,40 -0,22	13,64 -0,40	25,20 -0,64
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,34 -0,11	5,53 -0,11	17,63 -0,48	33,83 -0,95	52,74 -1,58
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 -0,00	0,26 -0,00	-0,30 -0,06	5,54 -0,10	17,83 -0,29	34,11 -0,67	53,19 -1,13
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,32	0,32	-0,04	5,96	17,95	37,21	56,61

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	0,06	0,20	0,32	-0,17	2,43	2,29
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	0,49	0,49	0,64	3,96	10,78	21,70	36,92
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,07	-0,07	-0,09	-0,18	-0,55	-0,98	-1,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	0,24	0,24	-0,31	5,48	17,72	33,86	52,51
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,07	-0,16	-0,39	-0,92	-1,81
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,40	0,40	1,08	2,80	6,12	13,11	24,45
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,04	-0,04	-0,11	-0,25	-0,49	-0,92	-1,39
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	-1,25	-1,25	4,86	11,84	18,21	34,36	41,31
Var. IBOVESPA p.p.	0,38	0,38	-1,24	0,11	1,41	0,39	-34,60
4UM SMALL CAPS FIA	0,69	0,69	21,92	31,14	51,07	75,48	160,97
Var. IBOVESPA p.p.	2,32	2,32	15,82	19,40	34,26	41,51	85,06
ITAU INDEX IBOVESPA 1	-1,70	-1,70	6,00	11,42	15,22	9,59	42,46
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-5,36	-5,36	-9,32	-9,81	-28,08	-33,98	-45,11
ARX INCOME FIA	-0,25	-0,25	12,46	19,83	23,26	56,78	100,34
Var. IBOVESPA p.p.	1,38	1,38	6,36	8,09	6,46	22,81	24,43
OCCAM FIC FIA	0,95	0,95	7,16	13,37	25,47	49,15	95,71
Var. IBOVESPA p.p.	2,58	2,58	1,06	1,64	8,66	15,18	19,80
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	0,62	0,62	8,68	15,29	27,77	60,37	104,20
Var. IBOVESPA p.p.	2,25	2,25	2,58	3,55	10,96	26,40	28,29
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	-1,16	-1,16	10,93	17,49	26,84	42,98	94,20
Var. IBOVESPA p.p.	0,47	0,47	4,83	5,76	10,03	9,01	18,29
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	-7,66	-7,66	1,37	3,77	14,51	23,65	
Var. IBOVESPA p.p.	-6,03	-6,03	-4,73	-7,96	-2,30	-10,32	
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32
IMA-C TOTAL	2,54	2,54	1,76	6,14	20,05	38,88	56,63
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	0,50	0,70	4,08	11,07	22,22	37,86
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
Renda Variável							
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06
Índice Consumo - ICON	3,66	3,66	15,32	21,23	43,29	43,57	87,57
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,82	15,10	14,63
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64
IPCA + 5,5%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33
INPC + 4%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95

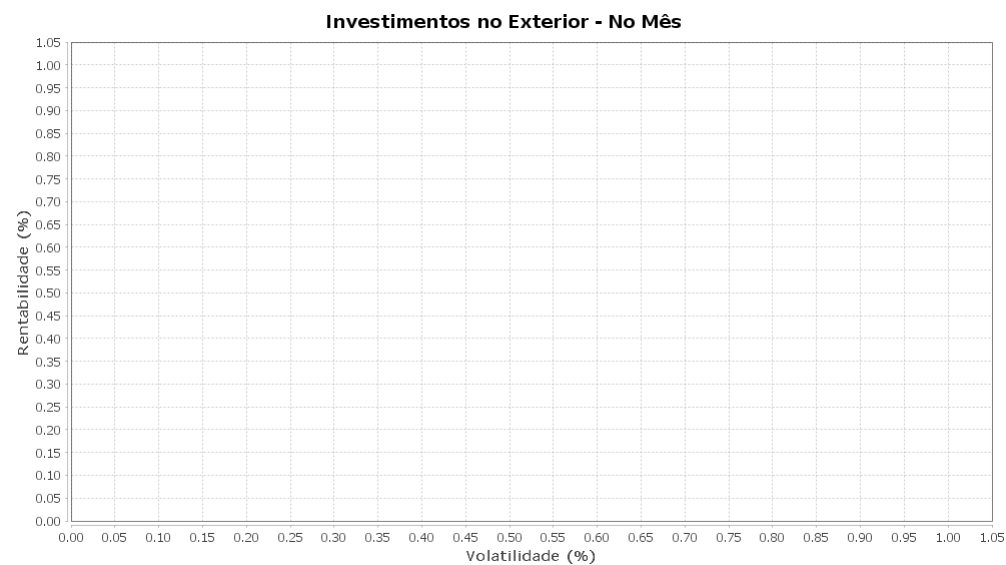
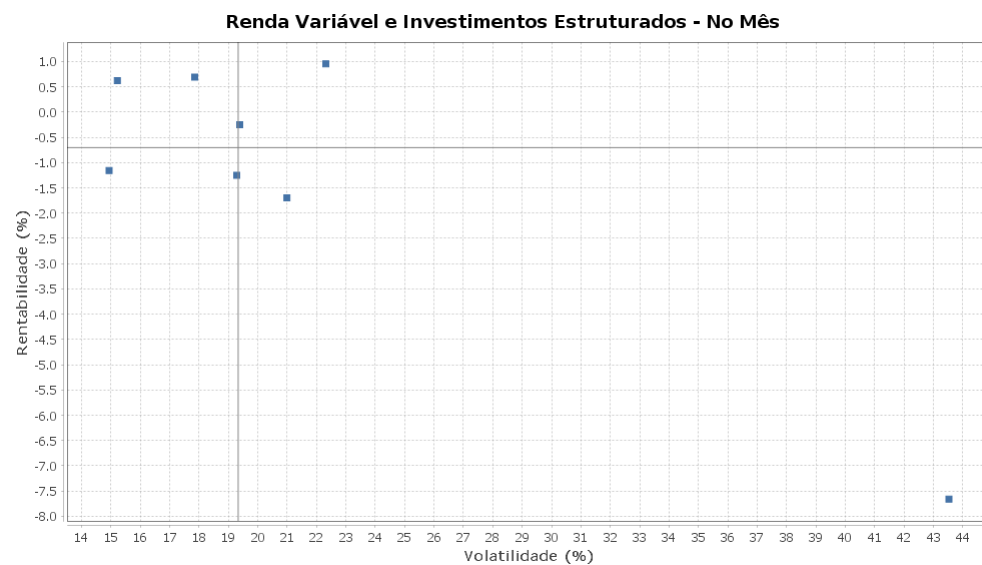
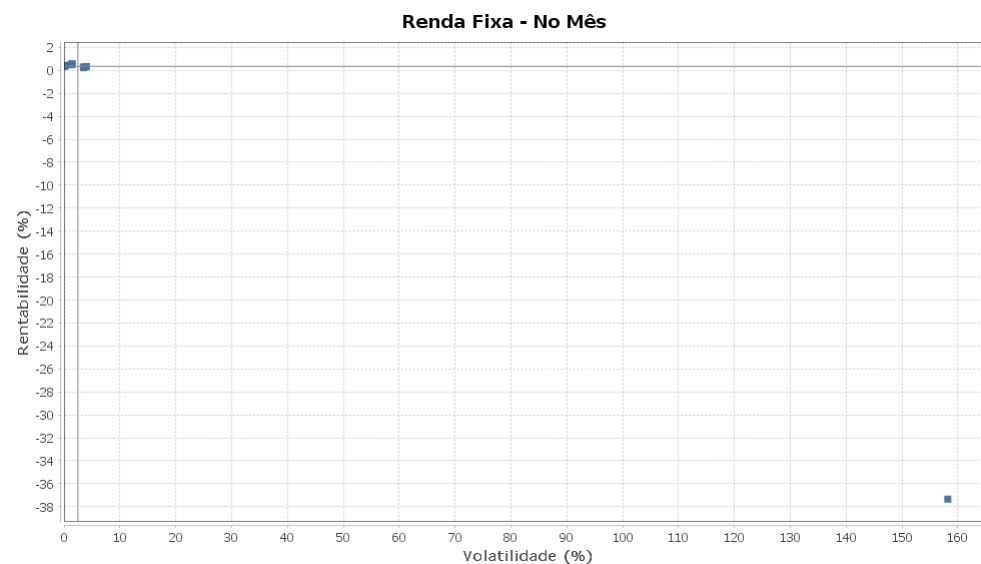
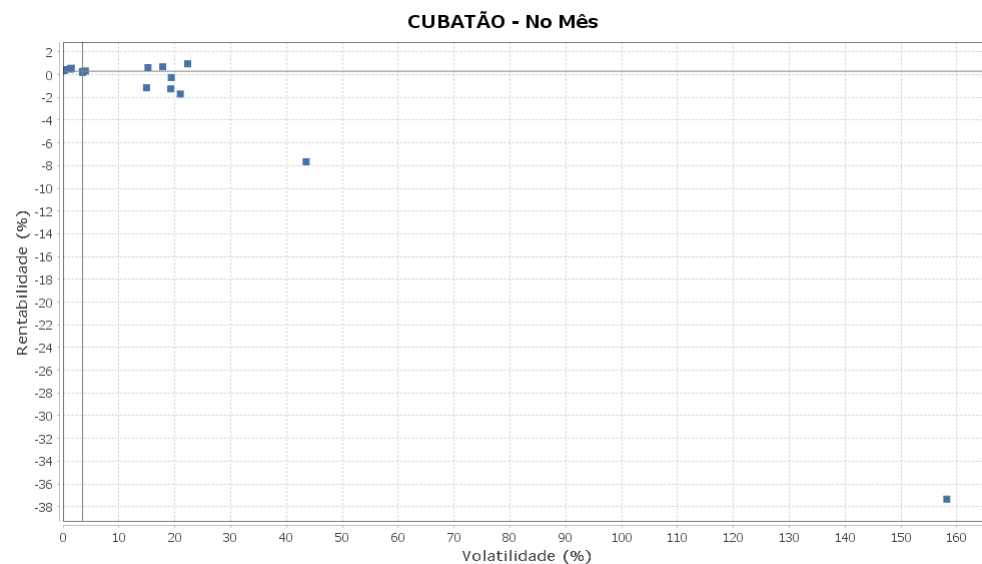
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
06/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	203.400,00	0,00	8.118,02309247	25,0553611000
06/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	3.651.400,00	0,00	19.937,22810100	183,1448174000
06/01/2020	BB PREVID RF IRF-M1	3.695.000,00	0,00	1.402.042,07675100	2,6354415900
08/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	26.300,00	1.049,06592300	25,0699212000
08/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	17.000,00	678,10344800	25,0699212000
08/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	629.000,00	3.433,24541500	183,2085750000
08/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	287.500,00	1.569,24969300	183,2085750000
08/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	3.800,00	20,74138800	183,2085750000
09/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	4.000,00	159,52934500	25,0737569000
09/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	167.600,00	914,64118500	183,2412567000
10/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	28.000,00	1.116,63067500	25,0754351000
10/01/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	490.000,00	185.772,97199191	2,6376280400
10/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	453.000,00	2.471,71949200	183,2732240000
15/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	6.000,00	239,08515700	25,0956608000
15/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	147.500,00	804,39681100	183,3672115000
20/01/2020	BB PREVID RF IRF-M1	195.000,00	0,00	73.843,41249904	2,6407230300
20/01/2020	BB PREVID RF IRF-M1	800.000,00	0,00	302.947,33332900	2,6407230300
23/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	107.200,00	4.267,57283600	25,1196650000
23/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.417.100,00	7.720,40646400	183,5525120000
23/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	11.369,55	0,00	452,61551100	25,1196650000
23/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	21.500,00	117,13269300	183,5525120000
24/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.100,00	11,43902000	183,5821709000
28/01/2020	BB PREVID RF IRF-M1	200.000,00	0,00	75.641,15488024	2,6440632790
30/01/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	4.400,00	175,02093100	25,1398503000
30/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	137.400,00	747,92524100	183,7082004000
30/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	38.100,00	207,39411700	183,7082004000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,37	47.792.478,59	6,12
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,37	12.990.605,72	1,66
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,02	0,02	0,38	8.088.192,73	1,04
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,40	18.638.033,94	2,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	42.809.011,25	5,48
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	997.766,36	0,13
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	89.759.927,77	11,49
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,32	0,16	0,54	16.738.148,15	2,14
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,49	15.392.118,02	1,97
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	1,49	0,18	0,57	65.530.442,48	8,39
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	0,37	0,26	29.721.046,67	3,81
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	0,37	0,24	28.018.487,61	3,59
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	Artigo 7º I, Alínea b	3,50	0,37	0,24	31.037.904,88	3,97
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	3,50	0,37	0,23	32.345.987,04	4,14
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,50	0,37	0,25	20.015.661,77	2,56
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	3,50	0,37	0,26	38.673.995,69	4,95
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	0,37	0,25	60.443.703,45	7,74
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	3,59	0,38	0,27	32.275.602,50	4,13
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	3,99	0,43	0,32	57.913.024,43	7,41
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,94	1,49	-1,16	20.860.792,89	2,67
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,22	1,61	0,62	11.194.682,24	1,43
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,85	1,88	0,69	15.362.093,18	1,97
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	19,28	1,94	-1,25	22.002.647,48	2,82
ARX INCOME FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,38	2,00	-0,25	27.293.854,74	3,49
ITAU INDEX IBOVESPA 1	Artigo 8º II, Alínea a	20,99	2,10	-1,70	5.468.976,21	0,70
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,31	2,36	0,95	27.211.873,05	3,48
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Artigo 8º IV, Alínea b	43,53	4,15	-7,66	2.516.250,00	0,32
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alínea a	158,21	14,27	-37,34	3.306,53	0,00