



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
MARÇO 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

RENTA FIXA

87,83%

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	10,74	-6,65	-6,04	18.760.498,87	2,60	181.128.548,29	10,36
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11,04	-6,95	-6,32	26.185.329,10	3,63	346.254.084,73	7,56
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,45	0,60	1,38	94.265.961,81	13,06	6.969.533.398,64	1,35
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12,57	-6,73	-5,84	54.352.633,67	7,53	1.204.323.174,71	4,51
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-6,33	27.766.403,95	3,85	5.743.378.118,49	0,48
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	11,10	-7,01	-6,39	28.985.757,41	4,01	708.758.244,80	4,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	56.397.370,15	7,81	5.890.819.394,91	0,96
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,45	0,57	1,31	18.912.804,00	2,62	181.046.812,14	10,45
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,44	0,59	1,38	43.217.064,70	5,99	10.517.651.272,61	0,41
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,44	0,58	1,35	1.007.077,55	0,14	874.359.185,40	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	4,75	-1,97	-1,06	15.154.917,12	2,10	1.326.400.859,08	1,14
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,69	-3,80	-3,06	385.005.818,33	53,32		

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	11,08	-7,00	-6,38	30.212.799,29	4,18	2.791.754.446,71	1,08
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			11,08	-7,00	-6,38	30.212.799,29	4,18		

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	0,18	-0,07	0,58	50.650.653,37	7,02	3.385.573.184,27	1,50
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,15	0,01	0,63	13.023.825,08	1,80	4.670.618.286,55	0,28
CEF	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	4,61	-1,75	-0,60	16.548.773,17	2,29	276.016.440,99	6,00

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	5,09	-2,07	-1,06	64.470.721,63	8,93	845.014.261,73	7,63
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	11,58	-7,20	-6,52	30.088.425,95	4,17	1.814.619.671,57	1,66
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	11,09	-7,12	-6,50	36.066.556,60	5,00	1.522.221.858,52	2,37
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,35	-3,10	-2,31	210.848.955,80	29,20		

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	152,86	-100,00	-83,89	0,00	0,00		
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			152,86	-100,00	-100,00	0,00	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	0,32	-0,55	0,10	8.066.064,54	1,12	9.238.698.632,72	0,09
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,32	-0,55	0,10	8.066.064,54	1,12		
Renda Fixa			6,35	-3,68	-2,94	634.133.637,96	87,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,17%

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	38,99	-29,74	-36,64	14.118.185,68	1,96	219.974.851,56	6,42
BNY MELLON	BNY MELLON	ARX INCOME FIA	38,35	-28,19	-33,75	18.128.892,77	2,51	501.656.927,12	3,61
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	34,66	-29,46	-33,99	7.343.931,31	1,02	1.330.411.885,84	0,55
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	28,70	-24,61	-29,20	10.802.049,30	1,50	116.385.348,38	9,28
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	32,27	-28,04	-33,30	14.076.887,79	1,95	199.846.922,58	7,04
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	40,74	-29,98	-36,98	3.505.856,21	0,49	37.718.001,61	9,29
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	38,44	-27,02	-33,33	17.970.171,78	2,49	487.277.709,57	3,69
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			35,32	-27,94	-33,71	85.945.974,84	11,90		

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	33,80	-20,15	-28,42	1.950.500,00	0,27		
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			33,80	-20,15	-27,46	1.950.500,00	0,27		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			34,97	-27,78	-33,58	87.896.474,84	12,17		
Total						722.030.112,80	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	385.005.818,33	53,32	0,00	40,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	30.212.799,29	4,18	0,00	5,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	210.848.955,80	29,20	0,00	23,85	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	0,00	0,00	0,00	0,05	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.066.064,54	1,12	0,00	1,10	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	634.133.637,96	87,83				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	85.945.974,84	11,90	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.950.500,00	0,27	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	87.896.474,84	12,17				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

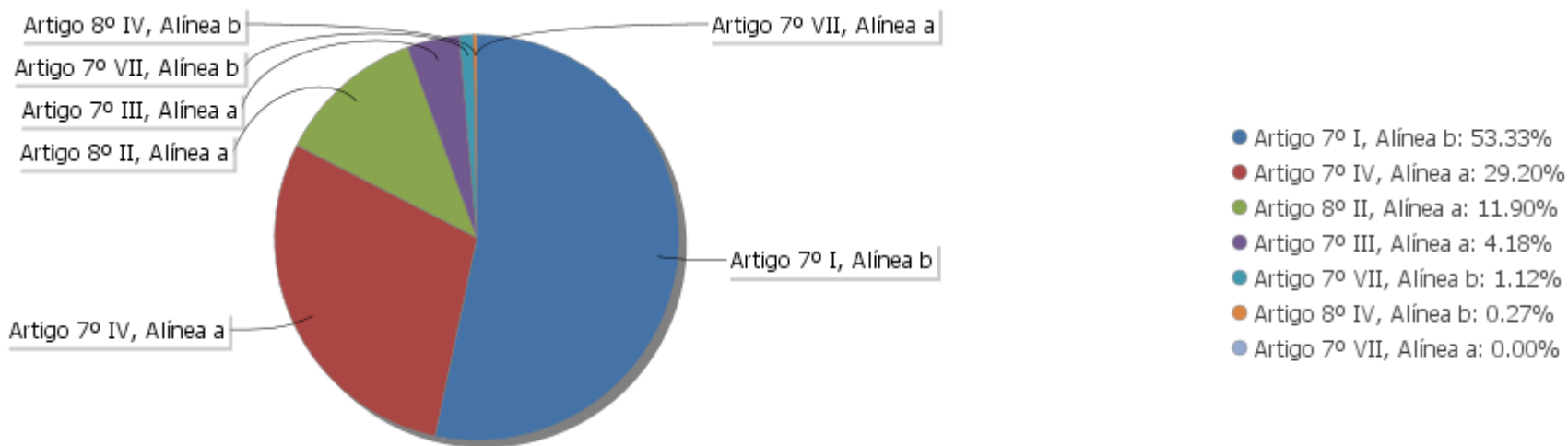
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-3,80 -1.121,99	-3,06 -302,66	-3,06 -302,66	-0,89 -39,47	8,20 150,81	-15.177.768,05	-12.167.489,35
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-7,00 -2.068,69	-6,38 -630,43	-6,38 -630,43	-3,82 -168,66	8,70 159,95	-2.274.016,92	-2.059.132,13
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-3,10 -916,57	-2,31 -228,02	-2,31 -228,02	-0,33 -14,54	6,97 128,22	-6.794.513,78	-5.025.972,67
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-100,00 -29.553,46	-100,00 -9.880,45	-100,00 -9.880,45	-100,00 -4.416,88	-100,00 -1.839,23	-849,86	-5.276,99
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,55 -163,26	0,10 10,31	0,10 10,31	1,12 49,52	4,23 77,78	-44.806,24	8.411,33
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-27,94 1,96	-33,71 3,15	-33,71 3,15	-25,04 5,24	-14,82 8,65	-33.325.717,43	-43.704.045,83
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-20,15 9,75	-27,46 9,39	-27,46 9,39	-11,42 18,86	-2,70 20,78	-493.150,00	-741.100,00
						-58.110.822,28	-63.694.605,64

Análise de Liquidez

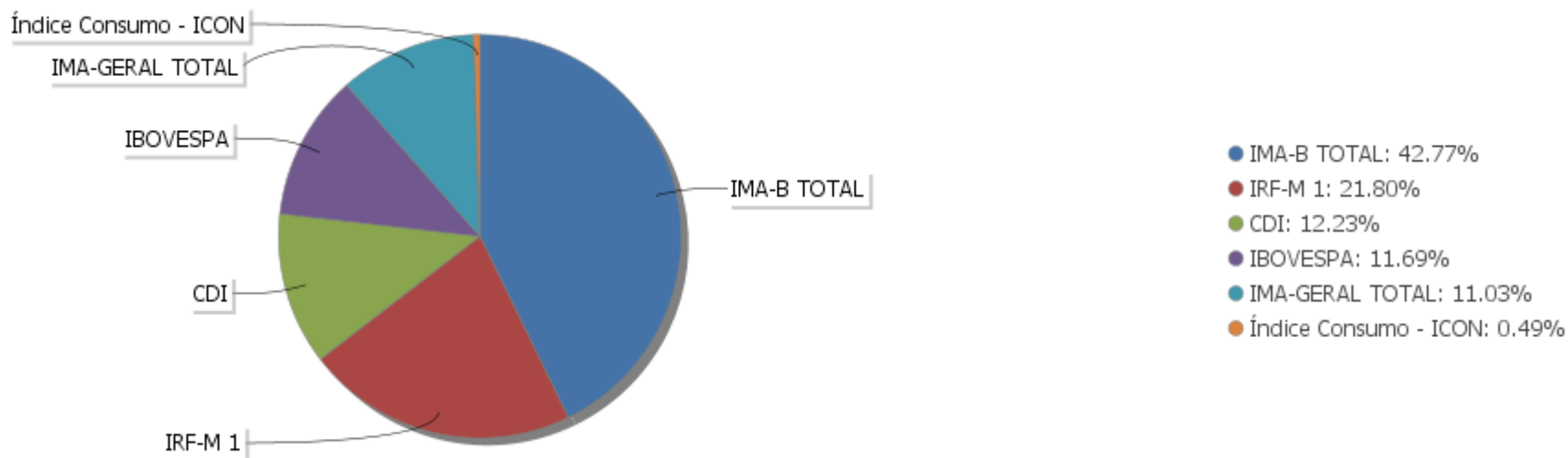
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	722.030.112,80	100,00	722.030.112,80	100,00
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	722.030.112,80	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	722.030.112,80	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

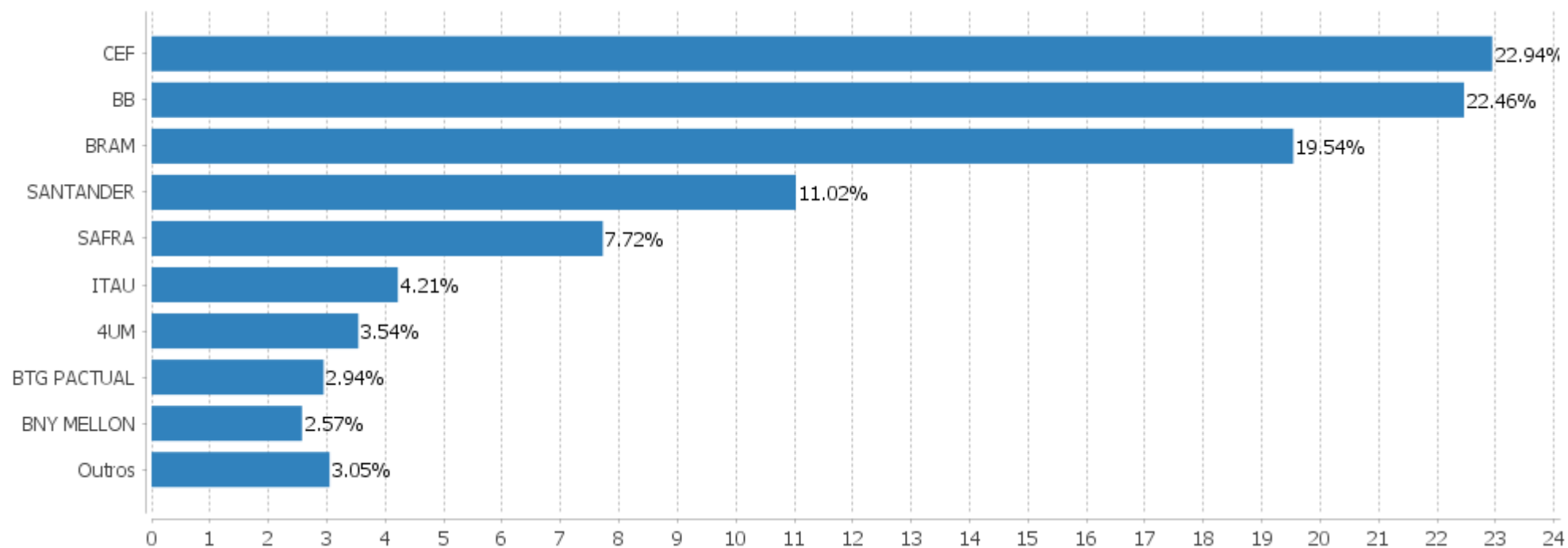


Alocação Por Estratégia



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	-0,94	-7,44										-8,09
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69										1,99
p.p. indexador	-0,47	-1,53	-8,13										-10,09
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

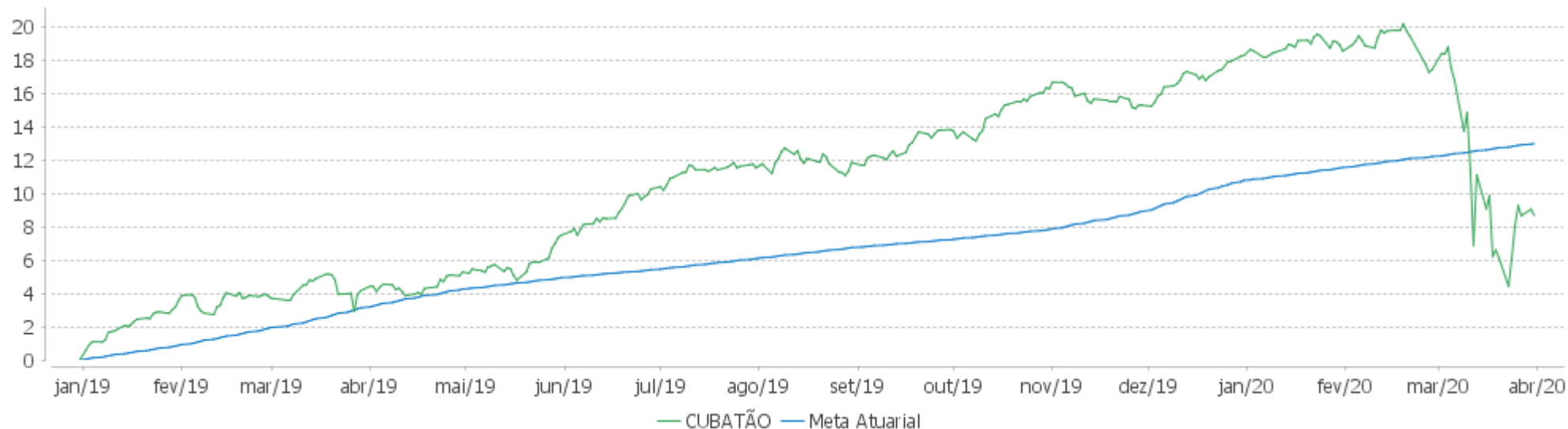
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

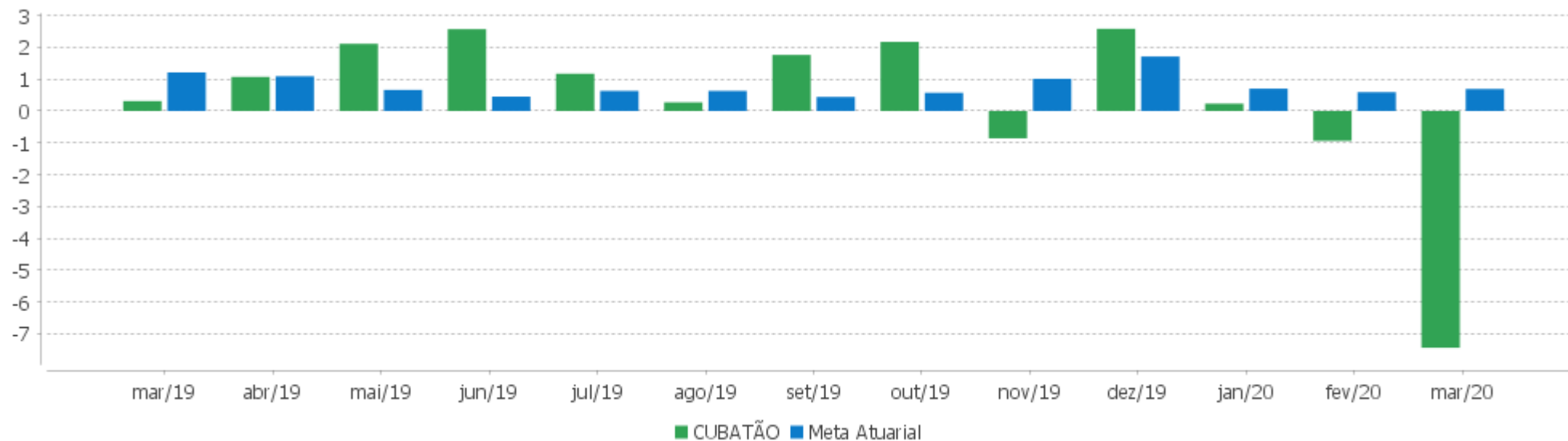
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	46,67	03 meses	-8,09	1,99	-10,09	18,33
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	53,33	06 meses	-4,50	5,38	-9,89	13,14
			12 meses	4,36	9,56	-5,20	9,64
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,58	2019-01	Desde 31/12/2018	8,69	12,98	-4,29	8,91
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	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 TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	-83,89 -8.289,20	-83,89 -8.289,20	-92,31 -4.077,42	-96,78 -1.780,07	-98,80 -814,86	-99,35 -461,44
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,00 -0,03	-6,38 -0,07	-6,38 -0,07	-3,82 -0,18	8,70 -0,44	23,48 -0,62	36,30 -1,12
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	-0,55 -163,26	0,10 10,31	0,10 10,31	1,12 49,52	4,23 77,78	10,79 89,02	20,35 94,53
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,95 0,03	-6,32 -0,01	-6,32 -0,01	-3,70 -0,06	8,94 -0,21	23,20 -0,91	35,81 -1,62
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 -0,03	1,35 -0,08	1,35 -0,08	2,68 -0,15	6,36 -0,30	13,19 -0,60	23,55 -0,87
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,01	1,38 -0,06	1,38 -0,06	2,70 -0,13	6,40 -0,26	13,27 -0,53	23,59 -0,83
BTG PACTUAL TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,65 0,32	-6,04 0,27	-6,04 0,27	-3,44 0,20	9,12 -0,02	23,66 -0,44	36,48 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,98 -0,01	-6,33 -0,02	-6,33 -0,02	-3,73 -0,09	8,93 -0,22	23,52 -0,58	36,42 -1,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,73 0,24	-5,84 0,47	-5,84 0,47	-2,91 0,73	9,71 0,57	26,82 2,72	39,96 2,54
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-1,97 0,01	-1,06 -0,07	-1,06 -0,07	0,76 -0,13	8,07 -0,40	17,87 -0,92	30,31 -1,28
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,01 -0,04	-6,39 -0,08	-6,39 -0,08	-3,80 -0,15	8,76 -0,38	23,20 -0,90	35,83 -1,60
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,04	1,31 -0,12	1,31 -0,12	2,59 -0,24	6,17 -0,49	12,86 -0,93	22,95 -1,46
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	-1,75 -517,69	-0,60 -59,35	-0,60 -59,35	1,82 80,61	8,76 161,03	16,85 138,95	28,48 132,30
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,20 -0,23	-6,52 -0,21	-6,52 -0,21	-3,85 -0,21	8,81 -0,33	23,49 -0,61	36,74 -0,69
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,01	0,63	0,63	1,80	4,93	11,46	21,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	1,98	61,91	61,91	79,37	90,67	94,51	98,78
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,12 -0,14	-6,50 -0,19	-6,50 -0,19	-3,88 -0,24	8,66 -0,48	23,30 -0,81	36,36 -1,06
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-2,07 -0,09	-1,06 -0,07	-1,06 -0,07	0,84 -0,05	8,50 0,03	18,60 -0,19	31,49 -0,11
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	-0,07 -21,48	0,58 57,61	0,58 57,61	1,69 74,75	4,81 88,50	11,43 94,27	20,92 97,16
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS Var. IBOVESPA p.p.	-20,53 9,38	-28,42 8,44	-28,42 8,44	-13,31 16,98	-7,56 15,91	-10,58 3,88	
GERAÇÃO FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-29,74 0,16	-36,64 0,22	-36,64 0,22	-30,61 -0,32	-23,56 -0,09	-14,78 -0,31	-8,12 -20,48
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-24,61 5,30	-29,20 7,66	-29,20 7,66	-12,76 17,53	6,54 30,01	21,61 36,08	76,77 64,41
ITAU INDEX IBOVESPA 1 Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-29,98 1,54	-36,98 -0,88	-36,98 -0,88	-30,49 -0,18	-24,28 -17,30	-26,59 -18,96	-9,69 -23,98
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-29,46 0,44	-33,99 2,87	-33,99 2,87	-27,38 2,91	-13,81 9,66	1,70 16,16	29,39 17,02
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-27,02 2,89	-33,33 3,53	-33,33 3,53	-28,56 1,73	-15,87 7,60	-4,48 9,98	30,78 18,42
ARX INCOME FIA Var. IBOVESPA p.p.	-28,19 1,71	-33,75 3,11	-33,75 3,11	-22,84 7,45	-15,10 8,37	0,48 14,94	32,68 20,32
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-28,04 1,86	-33,30 3,56	-33,30 3,56	-22,34 7,95	-12,57 10,90	-5,28 9,19	28,36 15,99
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

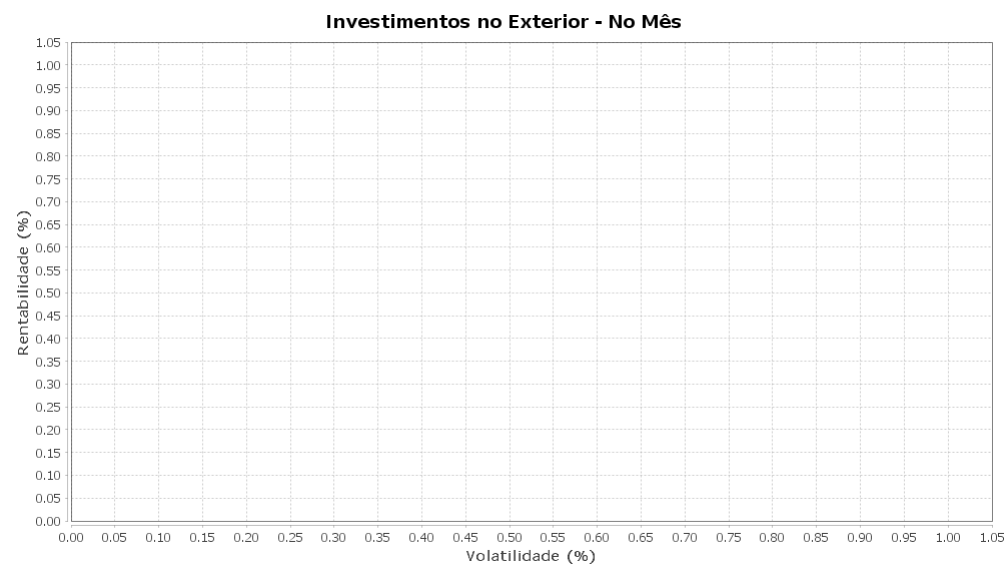
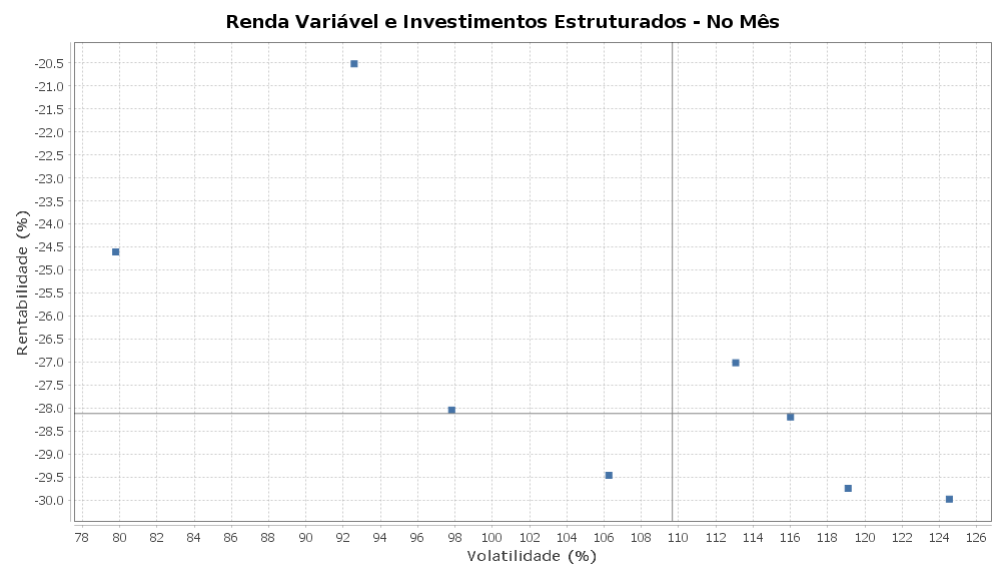
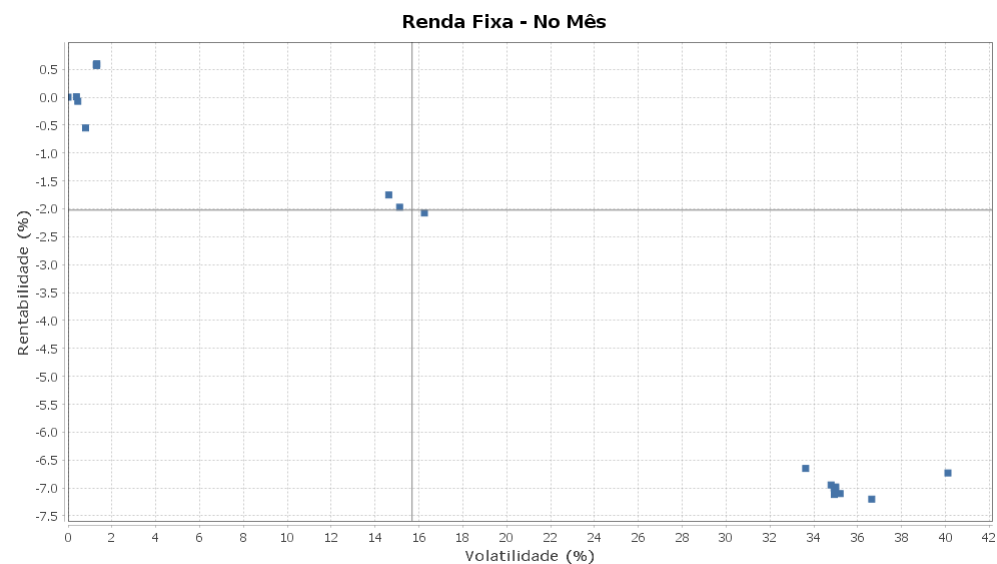
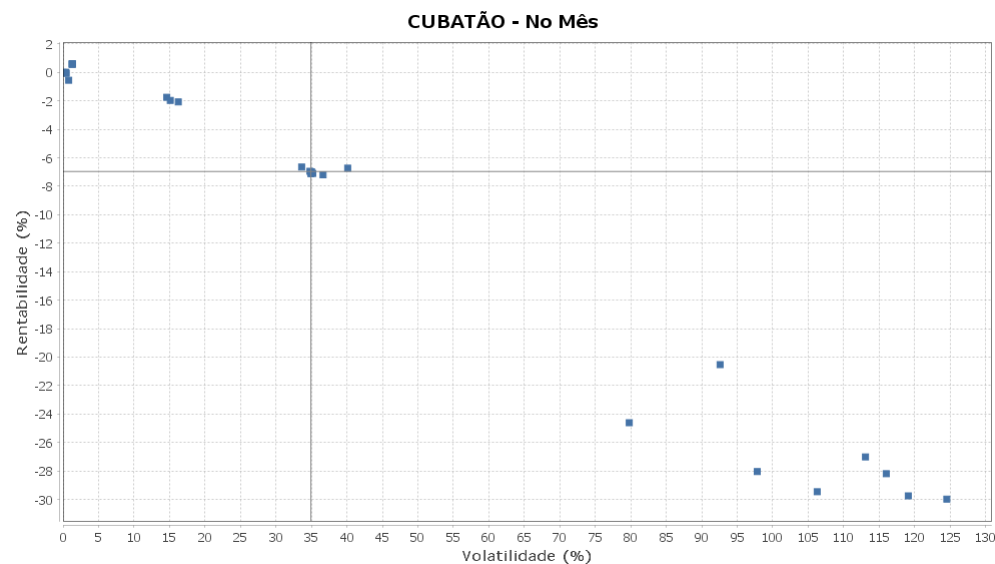
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
04/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	1.794.000,00	0,00	674.858,46511000	2,6583351810
05/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	2.375.700,00	0,00	12.886,42006300	184,3568647000
05/03/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	125.100,00	0,00	4.952,43681300	25,2602920000
06/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	7.000,00	37,96546700	184,3780855000
09/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	1.800.000,00	677.304,11511200	2,6575949560
13/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	478.000,00	0,00	179.862,11766200	2,6575913050
13/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	10.420,00	56,48892600	184,4609333000
13/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.333.650,00	7.229,98618900	184,4609333000
13/03/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	86.220,00	3.413,62371400	25,2576169000
18/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	221.000,00	0,00	83.060,36293500	2,6607155590
18/03/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.571,17	0,00	418,02120200	25,2885977000
24/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	170.000,00	0,00	63.791,20146100	2,6649443200
24/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	114.000,00	0,00	42.777,62921500	2,6649443200
30/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	11.300,00	0,00	4.234,96183600	2,6682648950
30/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	133.900,00	0,00	50.182,42388500	2,6682648950
30/03/2020	BB PREVID RF IRF-M1	3.600,00	0,00	1.349,19138100	2,6682648950
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	32.000,00	173,79444800	184,1255605000
30/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	100.700,00	546,90940100	184,1255605000
30/03/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	2.700,00	106,47889400	25,3571380000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	0,01	13.023.825,08	1,80
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,44	0,04	-0,07	50.650.653,37	7,02
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,80	0,06	-0,55	8.066.064,54	1,12
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	1,29	0,16	0,58	1.007.077,55	0,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,59	43.217.064,70	5,99
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,57	18.912.804,00	2,62
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,60	94.265.961,81	13,06
FIC CAIXA PATRIMÔNIO IP RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	14,62	1,43	-1,75	16.548.773,17	2,29
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	15,12	1,48	-1,97	15.154.917,12	2,10
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	16,25	1,59	-2,07	64.470.721,63	8,93
BTG PACTUAL TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	33,63	3,17	-6,65	18.760.498,87	2,60
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	34,78	3,28	-6,95	26.185.329,10	3,63
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	34,92	3,29	-7,00	30.212.799,29	4,18
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	34,93	3,28	-7,12	36.066.556,60	5,00
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	Artigo 7º I, Alínea b	34,98	3,29	-7,01	28.985.757,41	4,01
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	27.766.403,95	3,85
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	56.397.370,15	7,81
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	36,64	3,46	-7,20	30.088.425,95	4,17
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	40,11	3,84	-6,73	54.352.633,67	7,53
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	79,79	6,98	-24,61	10.802.049,30	1,50
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Artigo 8º IV, Alínea b	92,59	8,55	-20,53	1.950.500,00	0,27
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	97,82	8,64	-28,04	14.076.887,79	1,95
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	106,26	9,42	-29,46	7.343.931,31	1,02
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	113,07	10,28	-27,02	17.970.171,78	2,49
ARX INCOME FIA	Artigo 8º II, Alínea a	116,01	10,51	-28,19	18.128.892,77	2,51
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	119,10	10,74	-29,74	14.118.185,68	1,96
ITAU INDEX IBOVESPA 1	Artigo 8º II, Alínea a	124,53	11,28	-29,98	3.505.856,21	0,49