



SÃO JOSÉ DO RIO PRETO
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 14.04.2020.

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 **74,37%**

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 PREVID RF IRF-M1	0,45	0,60	1,38	1.572.022,56	0,47	6.969.533.398,64	0,02
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-6,33	15.659.496,34	4,64	5.743.378.118,49	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,44	0,59	1,38	19.030.172,40	5,64	10.517.651.272,61	0,18
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,44	0,58	1,35	1.337.217,08	0,40	874.359.185,40	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	4,75	-1,97	-1,06	4.194.058,93	1,24	1.326.400.859,08	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	12.009.623,65	3,56	9.363.308.744,85	0,13
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	3,77	-1,66	-0,66	8.891.590,61	2,64	6.723.745.548,10	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	4,61	-1,75	-0,60	7.032.093,58	2,08	1.150.828.120,38	0,61
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,65	-1,45	-0,41	3.681.937,83	1,09	8.199.299.170,30	0,04
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	7,89	-2,35	-0,46	8.156.979,61	2,42	620.106.851,00	1,32
BB	BB	BB PREV RF IPCA	5,54	-1,89	-0,47	4.887.753,20	1,45	338.561.511,94	1,44
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	5,33	-2,10	-1,18	28.572.113,99	8,47	10.536.452.770,12	0,27
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	5,32	-0,13	1,31	37.799.931,82	11,21	11.020.077.699,37	0,34
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	7,84	-2,69	-1,23	880.732,80	0,26	207.541.724,63	0,42
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	3,85	-1,71	-0,75	2.609.712,06	0,77	865.069.606,77	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,91	-1,67	-0,59	156.315.436,46	46,34		

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	35.691.167,64	10,58	2.791.754.446,71	1,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			11,08	-7,00	-6,38	35.691.167,64	10,58		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,15	0,01	0,63	2.502.870,02	0,74	4.670.618.286,55	0,05
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	11,58	-7,20	-6,52	16.348.253,83	4,85	1.814.619.671,57	0,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	14,47	-7,34	-6,07	4.277.397,20	1,27	414.421.356,30	1,03
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	-0,03	0,59	2.374.899,18	0,70	2.725.355.805,79	0,09
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,05	0,08	0,20	0,00	0,00	1.561.401.900,27	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,26	0,80	11.484.184,49	3,40	579.404.055,27	1,98
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	4,89	-1,78	-0,59	6.075.175,61	1,80	863.147.105,19	0,70
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	2,12	0,09	0,70	2.366.931,81	0,70	877.373.790,60	0,27
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	5,84	-2,11	-1,31	11.270.128,89	3,34	1.169.262.014,09	0,96
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC DE FI RF CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	0,05	0,01	0,01	268,12	0,00	763.917.901,43	0,00
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			7,02	-3,80	-2,96	56.700.109,15	16,81		

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
BB	BB	BB CRED PRIV III	4,08	-2,03	-0,90	2.168.995,19	0,64	579.731.612,89	0,37
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,08	-2,03	-0,90	2.168.995,19	0,64		
Renda Fixa			6,17	-2,92	-1,96	250.875.708,44	74,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,44%

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
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	39,50	-29,37	-36,43	2.759.345,60	0,82	86.348.577,23	3,20
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			39,50	-29,37	-36,43	2.759.345,60	0,82		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	39,39	-33,48	-39,99	3.931.141,57	1,17	448.913.209,63	0,88
BRAM	BEM	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	40,05	-31,64	-36,03	11.353.266,75	3,37	1.534.763.661,47	0,74
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	45,17	-38,17	-39,95	2.796.806,20	0,83	272.370.185,51	1,03
BB	BB	BB Acoes Setor Financeiro	39,83	-32,56	-38,67	1.498.805,41	0,44	174.973.757,74	0,86
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	37,74	-31,10	-34,53	11.459.885,21	3,40	375.488.566,24	3,05
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	33,55	-30,08	-33,95	1.983.288,05	0,59	249.309.970,86	0,80
BB	BB	BB PREVID ALOC	39,66	-31,67	-38,33	14.867.442,73	4,41	284.652.711,09	5,22
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	43,87	-29,90	-33,69	2.457.645,00	0,73	137.299.176,97	1,79
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			38,76	-31,96	-36,85	50.348.280,92	14,92		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	11,97	-8,45	-10,88	3.851.929,19	1,14	2.344.032.164,50	0,16
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	29,16	-15,12	-21,20	12.110.332,34	3,59	659.959.524,67	1,84
Sub-total Artigo 8º III			24,17	-13,60	-18,93	15.962.261,53	4,73		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	78,56	-5,52	17,86	6.634.706,38	1,97	211.647.127,49	3,13
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			78,56	-5,52	17,86	6.634.706,38	1,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados

32,30

-26,86

-30,99

75.704.594,43

22,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,19%

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 NIVEL I	23,76	6,30	6,80	3.620.989,87	1,07	876.229.505,18	0,41
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	23,69	2,40	7,80	5.732.476,20	1,70	442.267.478,67	1,30
BB	BB	BB Acoes Globais BDR Nivel I	23,32	8,04	6,22	1.413.049,53	0,42	157.202.985,28	0,90
Sub-total Artigo 9º A, III			22,86	4,41	7,25	10.766.515,60	3,19		
Investimentos no Exterior			22,86	4,41	7,25	10.766.515,60	3,19		
Total						337.346.818,47	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	156.315.436,46	46,34	10,00	45,40	70,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	35.691.167,64	10,58	0,00	10,00	20,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	56.700.109,15	16,81	0,00	14,50	40,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.168.995,19	0,64	0,00	0,60	5,00	15,00
	Total Renda Fixa	250.875.708,44	74,37				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	2.759.345,60	0,82	0,00	1,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	50.348.280,92	14,92	5,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.962.261,53	4,73	0,00	5,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	6.634.706,38	1,97	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	75.704.594,43	22,44				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	10.766.515,60	3,19	0,00	2,50	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	10.766.515,60	3,19				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

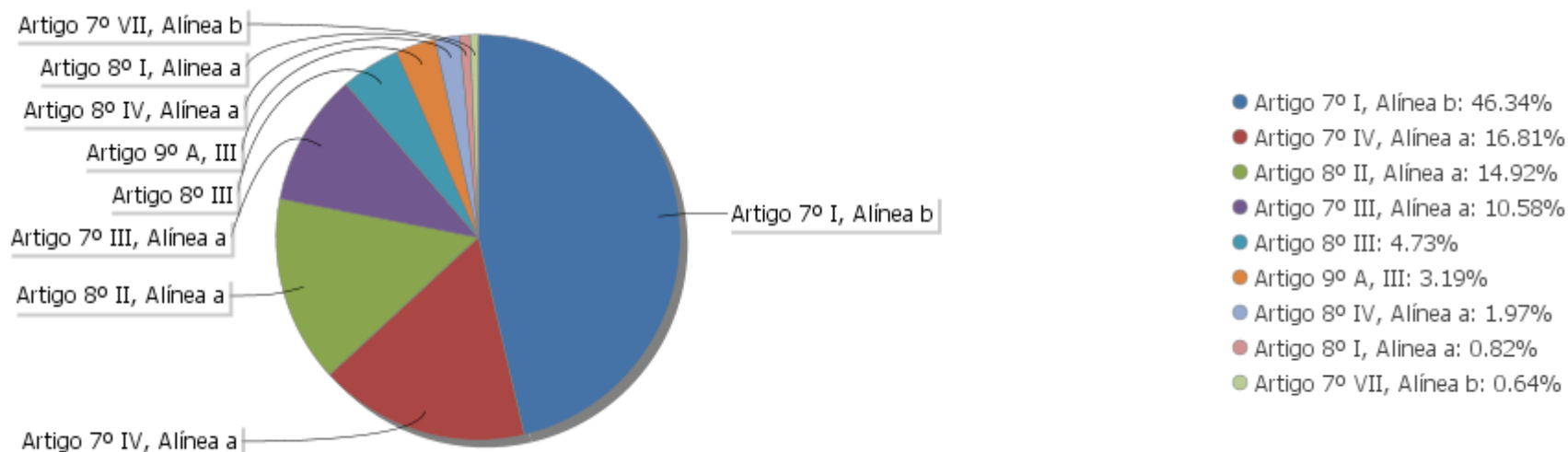
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,67 -494,90	-0,59 -57,98	-0,59 -57,98	1,44 63,70	9,04 166,22	-2.696.049,44	-887.196,44
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-7,00 -2.068,69	-6,38 -630,43	-6,38 -630,43	-3,82 -168,66		-2.681.864,58	-2.431.283,45
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-3,80 -1.121,89	-2,96 -292,91	-2,96 -292,91	-0,97 -42,90	7,52 138,40	-1.947.621,48	-1.516.201,14
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-2,03 -601,37	-0,90 -89,41	-0,90 -89,41	1,51 66,53	8,06 148,18	-45.052,39	-19.807,85
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-29,37 0,54	-36,43 0,43	-36,43 0,43	-29,95 0,34		-1.147.285,10	-1.581.549,91
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-31,96 -2,06	-36,85 0,01	-36,85 0,01	-27,70 2,59	-19,36 4,11	-23.650.829,95	-29.375.309,28
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-13,60 16,31	-18,93 17,93	-18,93 17,93	-12,56 17,73	-7,10 16,37	-2.512.156,42	-3.727.774,19
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,52 24,38	17,86 54,72	17,86 54,72	38,61 68,90	27,62 51,09	-210.432,81	1.031.630,11
Artigo 9º A, III % do CDI	4,41 1.302,32	7,25 716,61	7,25 716,61	13,39 591,27	26,99 496,42	454.418,79	728.069,92
						-34.436.873,38	-37.779.422,23

Análise de Liquidez

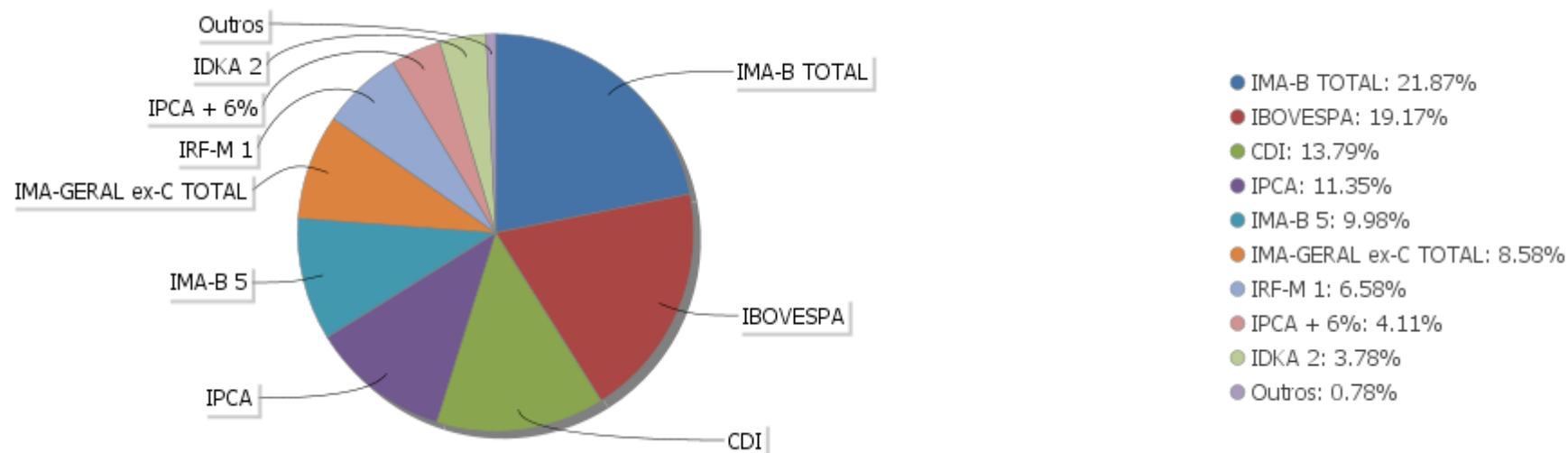
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	308.705.033,63	91,51	308.705.033,63	91,51
de 31 a 364 dias	11.459.885,21	3,40	320.164.918,84	94,91
acima de 365 dias	17.181.899,63	5,09	337.346.818,47	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

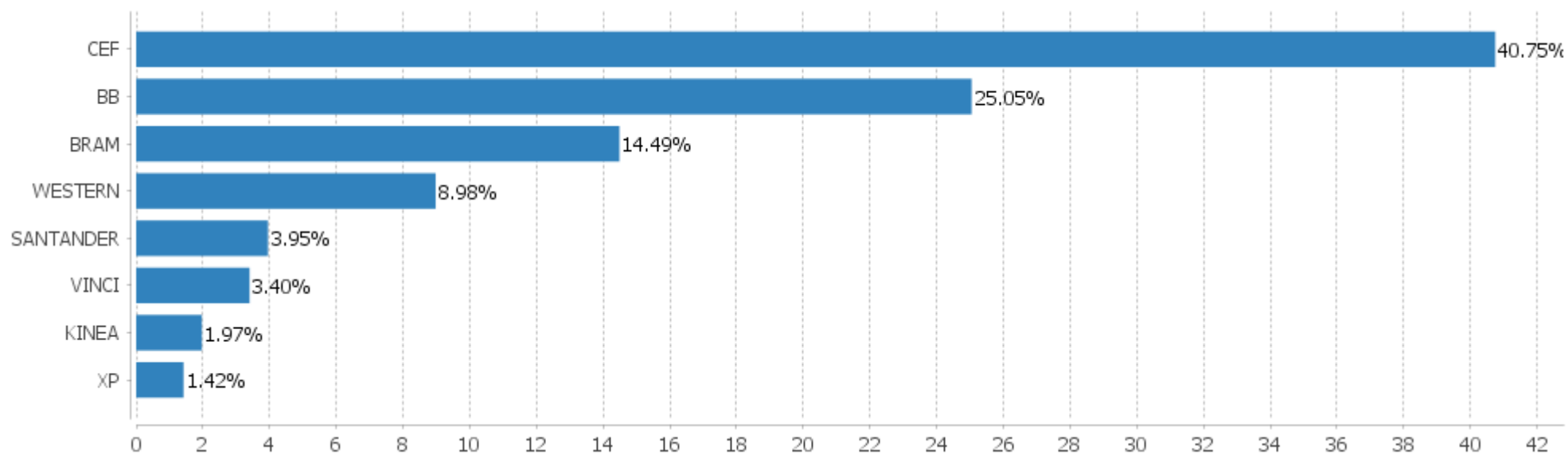


Alocação Por Estratégia



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	0,63	-1,53	-9,41										-10,22
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57										1,96
p.p. indexador	-0,08	-2,19	-9,98										-12,18
2019	2,75	0,44	0,65	1,23	1,25	2,60	1,03	0,30	1,91	2,01	0,09	2,58	18,15
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	1,92	-0,46	-0,55	0,17	0,61	2,15	0,31	-0,32	1,46	1,37	-0,89	0,93	7,56
2018	2,74	0,16	0,62	0,32	-2,83	-0,62	1,78	0,19	0,78	1,99	0,94	0,34	6,48
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,93	-0,58	0,04	-0,39	-3,72	-2,37	0,94	-0,25	-0,14	1,03	0,68	-0,27	-3,44

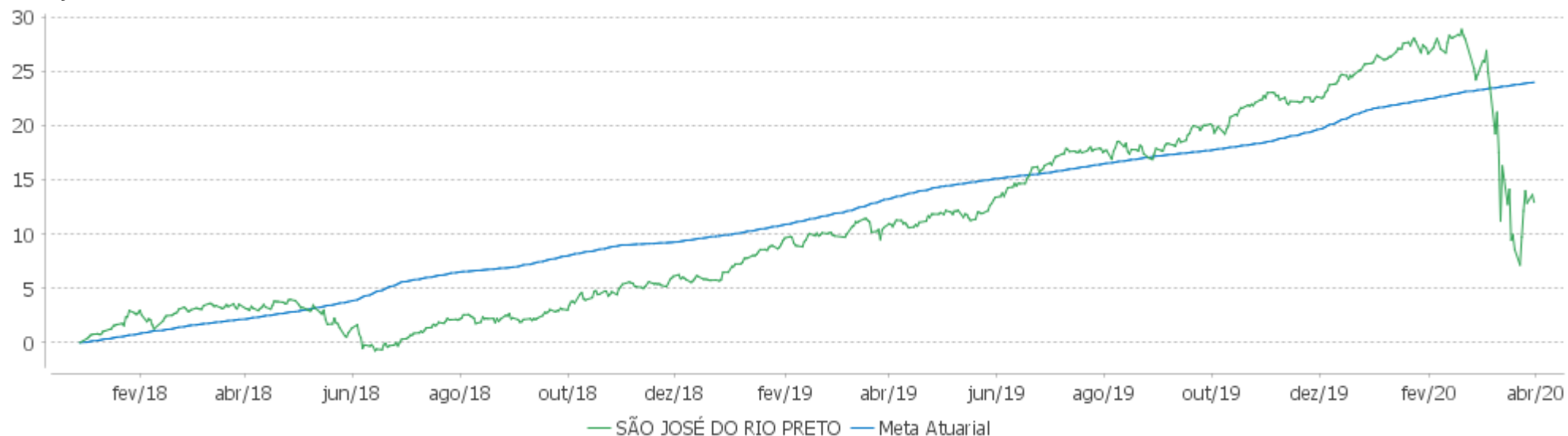
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

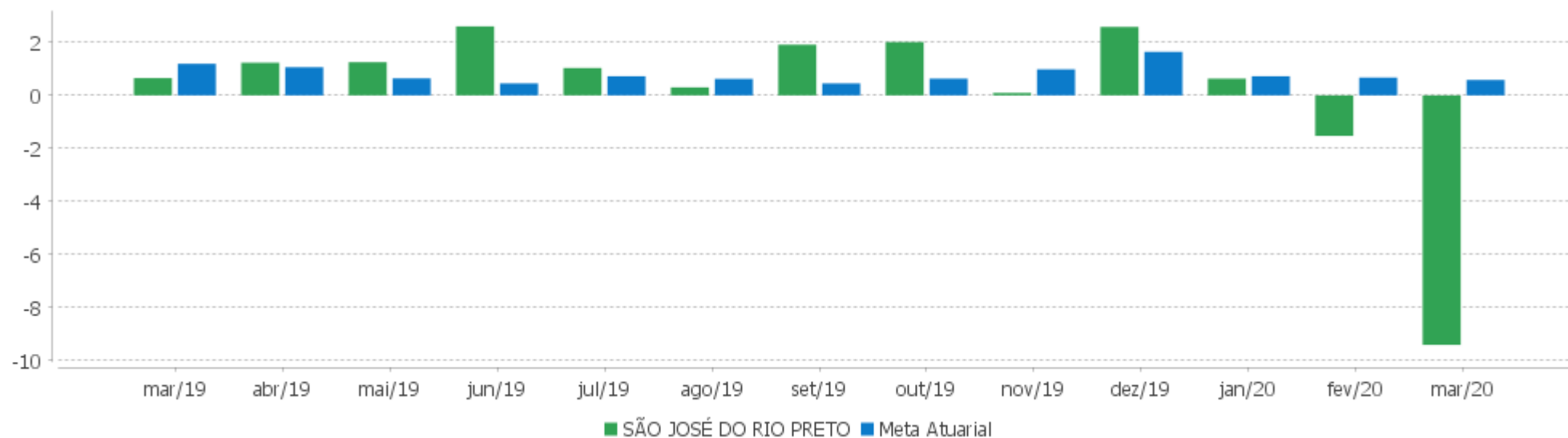
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	48,15	03 meses	-10,22	1,96	-12,18	23,54
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	51,85	06 meses	-5,98	5,31	-11,28	16,76
			12 meses	2,11	9,52	-7,41	12,16
			24 meses	9,09	21,35	-12,26	9,11
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,75	2019-01	Desde 29/12/2017	12,94	23,94	-11,00	8,70
Menor rentabilidade da Carteira	-9,41	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
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
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 INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-1,78 -0,03	-0,59 -0,01	-0,59 -0,01	1,93 -0,09	9,18 -0,16	18,81 -0,58	32,94 -0,74
SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS % do CDI	0,09 27,22	0,70 69,29	0,70 69,29	3,07 135,41	10,94 201,23	16,52 136,23	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,01 1,98	0,63 61,91	0,63 61,91	1,80 79,37	4,93 90,67	11,46 94,51	21,27 98,78
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,34 -0,36	-6,07 0,24	-6,07 0,24	-3,20 0,45	11,46 2,32	27,98 3,88	42,92 5,50
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	-0,03 -9,77	0,59 58,36	0,59 58,36	1,74 76,63	4,81 88,50	11,34 93,51	20,78 96,50
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,25 73,55	0,75 74,38	0,75 74,38	1,73 76,27	4,31 79,23	9,74 80,32	17,73 82,36
BRADESCO FIC DE FI RF CURTO PRAZO PODER PÚBLICO % do CDI	0,11 33,78	0,38 37,18	0,38 37,18	0,96 42,46	2,74 50,43		
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,26 78,23	0,80 79,03	0,80 79,03	1,83 81,02	4,55 83,67	10,26 84,64	18,56 86,21
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA % do CDI	-2,11 -624,25	-1,31 -129,34	-1,31 -129,34	0,48 20,99	7,84 144,28	17,51 144,38	
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	-2,03 -2,62	-0,90 -2,89	-0,90 -2,89	1,51 -3,83	8,06 -1,50	18,88 -2,50	34,46 2,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	-2,35 -0,59	-0,46 0,12	-0,46 0,12	2,37 0,34	11,68 2,34	23,22 3,83	39,81 6,14
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,75 0,01	-0,60 -0,03	-0,60 -0,03	1,94 -0,09	9,12 -0,22	18,91 -0,48	32,89 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	-1,71	-0,75	-0,75	1,75	8,65	28,74	40,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 6% p.p.	-2,40	-2,74	-2,74	-3,64	-0,91	7,24	9,94
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	-1,97	-1,06	-1,06	0,76	8,07	17,87	30,31
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,01	-0,07	-0,07	-0,13	-0,40	-0,92	-1,28
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	-2,69	-1,23	-1,23	1,62	11,89	22,61	31,30
Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,28	5,08	5,08	5,26	2,75	-1,50	-6,12
BB PREV RF IDKA2	-1,66	-0,66	-0,66	1,94	7,78	17,10	30,56
Var. IDKA 2 p.p.	-0,45	-0,66	-0,66	-0,52	-1,34	-2,04	-3,36
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,58	1,35	1,35	2,68	6,36	13,19	23,55
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,08	-0,08	-0,15	-0,30	-0,60	-0,87
BB PREV RF IPCA	-1,89	-0,47	-0,47	2,19	11,28	22,26	37,52
Var. IPCA + 6% p.p.	-2,47	-2,46	-2,46	-3,14	1,72	0,88	5,56
BB PREV ALOC FIC	-2,10	-1,18	-1,18	0,61	8,55	18,63	30,83
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,17	-0,17	-0,17	-0,26	0,22	0,23	-0,39
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	-0,13	1,31	1,31	3,13	13,46	23,65	35,73
Var. IPCA p.p.	-0,20	0,78	0,78	0,82	10,16	15,62	24,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	-1,45	-0,41	-0,41	1,98	8,03	17,44	30,97
Var. IDKA 2 p.p.	-0,24	-0,41	-0,41	-0,48	-1,08	-1,70	-2,96
BB PREV IMAB TPB	-6,98	-6,33	-6,33	-3,73	8,93	23,52	36,42
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,02	-0,02	-0,09	-0,22	-0,58	-1,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,59	1,38	1,38	2,73	6,46	13,39	23,77
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,11	-0,20	-0,41	-0,64
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-29,90	-33,69	-33,69	-21,82			
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	3,17	3,17	8,47			
BB PREVID ALOC	-31,67	-38,33	-38,33	-30,98	-24,65	-14,59	7,09
Var. IBOVESPA p.p.	-1,77	-1,47	-1,47	-0,69	-1,18	-0,13	-5,28
XP INVESTOR FI DE ACOES	-38,17	-39,95	-39,95	-30,06	-15,37	-5,18	30,03
Var. IBOVESPA p.p.	-8,26	-3,09	-3,09	0,23	8,10	9,29	17,66
FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	-31,10	-34,53	-34,53	-22,63	-9,40	3,86	38,10
Var. IBOVESPA p.p.	-1,20	2,33	2,33	7,65	14,07	18,32	25,73
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	-33,48	-39,99	-39,99	-33,17	-25,13	-14,40	11,01
Var. IBOVESPA p.p.	-3,57	-3,14	-3,14	-2,88	-1,65	0,06	-1,35
BB Acoes Setor Financeiro	-32,56	-38,67	-38,67	-34,11	-27,18	-18,27	8,34
Var. IBOVESPA p.p.	-2,66	-1,81	-1,81	-3,82	-3,71	-3,80	-4,03
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	-30,08	-33,95	-33,95	-23,63	-7,75	11,58	34,28
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	2,91	2,91	6,66	15,72	26,04	21,91
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	-31,64	-36,03	-36,03	-26,34	-12,50	5,75	42,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,74	0,83	0,83	3,95	10,97	20,21	30,02
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-15,12 -4.467,68	-21,20 -2.094,46	-21,20 -2.094,46	-14,24 -629,13	-8,19 -150,57	2,65 21,82	22,06 102,47
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	-8,45 -2.496,14	-10,88 -1.074,60	-10,88 -1.074,60	-6,80 -300,22	-1,89 -34,79	5,16 42,60	19,52 90,64
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-29,37 0,54	-36,43 0,43	-36,43 0,43	-29,95 0,34	-23,37 0,10	-14,82 -0,36	11,01 -1,35
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6% p.p.	-5,52 -6,10	17,86 15,88	17,86 15,88	38,61 33,28	72,07 62,52		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,30 36,21	6,80 43,65	6,80 43,65	12,71 43,00	27,06 50,53	62,46 76,92	91,78 79,42
BB Acoes Globais BDR Nivel I Var. IBOVESPA p.p.	8,04 37,94	6,22 43,08	6,22 43,08	13,91 44,20	21,84 45,31	52,72 67,18	76,66 64,30
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N Var. IBOVESPA p.p.	2,40 32,31	7,80 44,66	7,80 44,66	13,69 43,98	28,39 51,86	66,56 81,02	94,40 82,04
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			-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

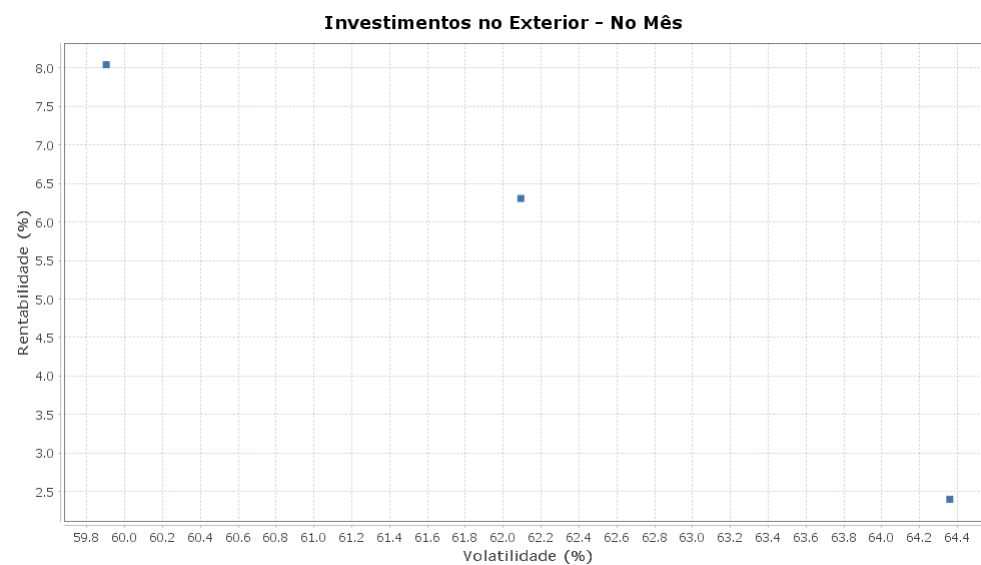
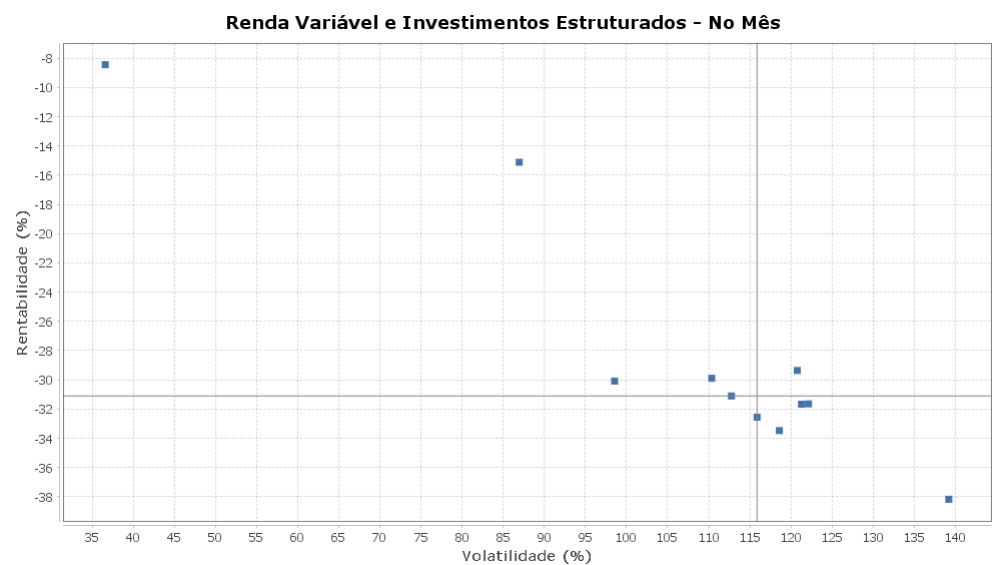
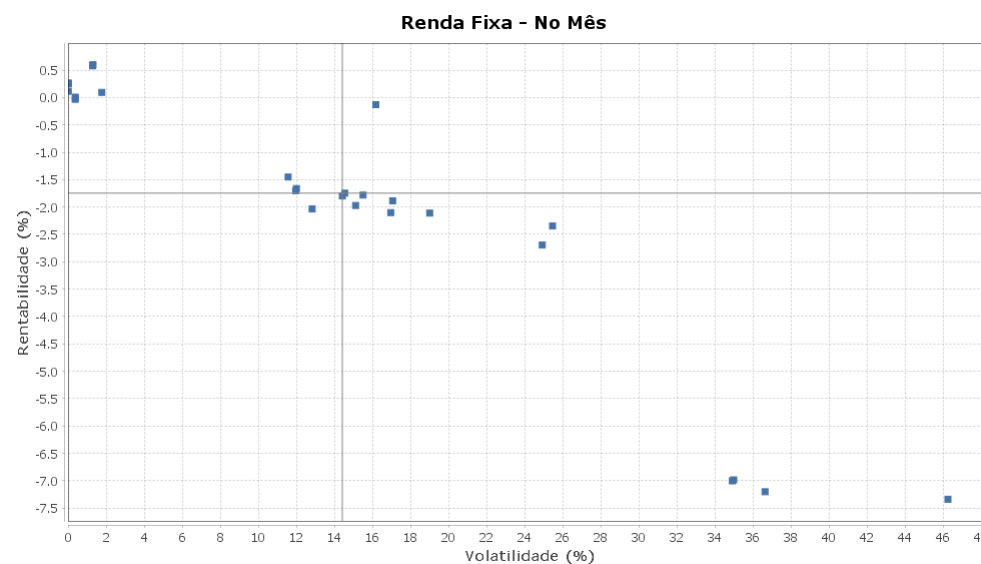
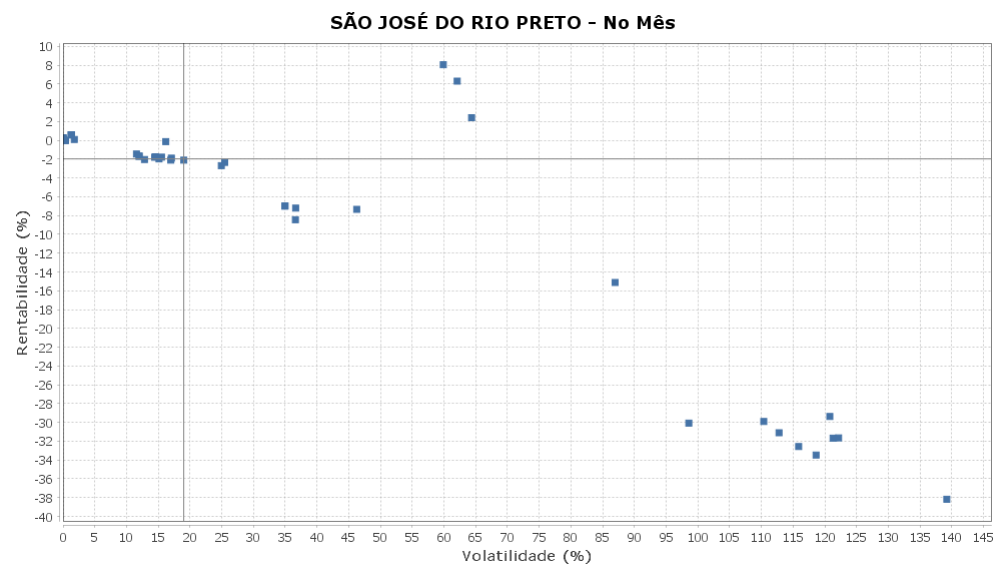
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	798.761,64	430.230,01513200	1,8565920831
05/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	12.029,39	0,00	5.751,43423000	2,0915461290
05/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	94.713,90	0,00	50.995,53221900	1,8572980000
06/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.199.553,91	645.777,95870600	1,8575330635
09/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.944,24	2.123,09029500	1,8577825019
10/03/2020	BB PREV IMAB TPB	15.904,95	0,00	2.608,57968500	6,0971685440
10/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	15.904,95	7.601,73918073	2,0922777830
10/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	14.157,27	7.619,59406600	1,8580084290
10/03/2020	FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	251.561,62	0,00	68.572,23153200	3,6685640000
11/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.492,60	2.417,65398100	1,8582477209
12/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.505,98	1.348,39190900	1,8584952811
13/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.334,14	1.255,77721500	1,8587140000
16/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.851,66	996,06386800	1,8589771796
17/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	523,00	0,00	281,30590400	1,8591860000
18/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	14.544,81	7.822,20621000	1,8594255392
20/03/2020	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	584.562,00	48.220,74700000	12,1226242000
20/03/2020	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	584.562,00	0,00	584.562,00000000	1,0000000000
23/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.734,55	5.233,44667600	1,8600648106
25/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	194.818,44	104.715,02069700	1,8604631762
26/03/2020	BRASESCO FIC DE FI RF CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	6.664.572,98	0,00	4.064.974,33352000	1,6395117000
26/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	27.417,66	14.735,41313200	1,8606640000
26/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	1.500.000,00	587.358,40223600	2,5538070000
27/03/2020	BRASESCO FIC DE FI RF CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	0,00	6.664.573,98	4.064.810,81503000	1,6395779000
27/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	366.801,13	197.113,23306400	1,8608650688
30/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.248.724,71	0,00	4.432.253,25995600	1,8610680000
31/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	550.460,09	0,00	295.744,19308000	1,8612710000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,26	11.484.184,49	3,40
BRADESCO FIC DE FI RF CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,11	268,12	0,00
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,25	0,00	0,00
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	-0,03	2.374.899,18	0,70
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	0,01	2.502.870,02	0,74
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	1,29	0,16	0,58	1.337.217,08	0,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,59	19.030.172,40	5,64
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,60	1.572.022,56	0,47
SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	Artigo 7º IV, Alínea a	1,78	0,19	0,09	2.366.931,81	0,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,13	-1,45	3.681.937,83	1,09
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,96	1,16	-1,71	2.609.712,06	0,77
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	12,01	1,17	-1,66	8.891.590,61	2,64
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	12,83	1,24	-2,03	2.168.995,19	0,64
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	12.009.623,65	3,56
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	14,54	1,43	-1,75	7.032.093,58	2,08
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	15,12	1,48	-1,97	4.194.058,93	1,24
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	15,51	1,52	-1,78	6.075.175,61	1,80
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	1,67	-0,13	37.799.931,82	11,21
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	16,96	1,66	-2,10	28.572.113,99	8,47
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	17,06	1,68	-1,89	4.887.753,20	1,45
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	19,01	1,87	-2,11	11.270.128,89	3,34
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	24,93	2,46	-2,69	880.732,80	0,26
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	25,47	2,53	-2,35	8.156.979,61	2,42
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	34,92	3,29	-7,00	35.691.167,64	10,58
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	15.659.496,34	4,64
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	36,60	3,39	-8,45	3.851.929,19	1,14
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	36,64	3,46	-7,20	16.348.253,83	4,85
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	46,26	4,45	-7,34	4.277.397,20	1,27
BB Acoes Globais BDR Nivel I	Artigo 9º A, III	59,90	6,56	8,04	1.413.049,53	0,42
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Artigo 9º A, III	62,09	6,71	6,30	3.620.989,87	1,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	Artigo 9º A, III	64,36	6,78	2,40	5.732.476,20	1,70
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	86,96	8,26	-15,12	12.110.332,34	3,59
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	98,56	8,59	-30,08	1.983.288,05	0,59
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	110,36	9,82	-29,90	2.457.645,00	0,73
FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	112,77	9,99	-31,10	11.459.885,21	3,40
BB Acoes Setor Financeiro	Artigo 8º II, Alínea a	115,88	10,22	-32,56	1.498.805,41	0,44
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	118,60	10,44	-33,48	3.931.141,57	1,17
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	120,77	10,93	-29,37	2.759.345,60	0,82
BB PREVID ALOC	Artigo 8º II, Alínea a	121,30	10,84	-31,67	14.867.442,73	4,41
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	122,15	10,93	-31,64	11.353.266,75	3,37
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	139,20	12,24	-38,17	2.796.806,20	0,83