



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
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 05.01.2021.

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

76,84%

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,60	1,38	60.515,86	0,01	6.969.533.398,64	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	11,10	-7,01	-6,39	13.067.934,77	2,16	708.758.244,80	1,84
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,16	-7,10	-6,46	101.471.510,97	16,75	5.890.819.394,91	1,72
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,45	0,59	1,37	15.102,97	0,00	267.943.112,01	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,59	1,38	77.491,60	0,01	10.517.651.272,61	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,58	-1,80	-0,64	107.171.578,30	17,69	9.363.308.744,85	1,14
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	11,14	-7,17	-6,54	18.668.176,89	3,08	1.314.979.649,02	1,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	-0,11	1,36	35.494.268,06	5,86	15.907.113.181,36	0,22
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	7,89	-2,35	-0,46	2.328.868,10	0,38	620.106.851,00	0,38
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,56	-1,79	-0,60	12.550.694,73	2,07	4.397.326.460,64	0,29
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,19	-1,65	-0,46	15.510.322,22	2,56	511.077.659,07	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5,33	-2,10	-1,18	53.847.852,16	8,89	10.536.452.770,12	0,51
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,32	-0,13	1,31	64.058.224,75	10,57	11.020.077.699,37	0,58
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	3,85	-1,71	-0,75	4.306.024,92	0,71	865.069.606,77	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,45	-2,85	-1,77	428.628.566,30	70,74		

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	6.672.408,08	1,10	3.385.573.184,27	0,20
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	12,40	-7,40	-6,78	5.418.440,79	0,89	312.515.004,99	1,73
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	11,09	-7,12	-6,50	1.463.844,48	0,24	1.522.221.858,52	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,32	0,53	1,13	23.375.444,55	3,86	5.019.962.419,71	0,47
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,46	-1,12	-0,51	36.930.137,90	6,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

6,14

-2,72

-1,68

465.558.704,20

76,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,30%

Artigo 8º I, Alínea b (Fundos de Índices Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	74,62	-29,90	-36,85	23.078.884,04	3,81	6.413.247.065,49	0,36
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			74,62	-29,90	-36,85	23.078.884,04	3,81		

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	3.008.275,11	0,50	448.913.209,63	0,67
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	34,66	-29,46	-33,99	609.811,78	0,10	1.330.411.885,84	0,05
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	42,57	-39,40	-43,18	11.565.131,27	1,91	467.606.855,85	2,47
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	36,80	-29,79	-35,13	18.773.733,49	3,10	223.832.027,97	8,39
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	37,74	5,11	5,11	6.937.227,69	1,14	375.488.566,24	1,85
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	44,50	-37,91	-39,66	12.226.572,93	2,02	451.328.845,29	2,71
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	37,39	-27,05	-34,54	1.463.495,23	0,24	606.513.004,24	0,24
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	35,44	-27,40	-30,98	8.049.739,10	1,33	668.247.605,13	1,20
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,87	6,80	6,80	7.048.514,99	1,16	590.532.828,22	1,19
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	46,58	-5,50	-5,50	6.237.167,94	1,03	143.156.574,01	4,36
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	45,10	-20,06	-20,06	1.049.554,05	0,17	574.915.136,37	0,18
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	33,40	-28,04	-30,77	10.330.036,54	1,70	147.373.614,90	7,01
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,05	-33,52	-37,24	87.299.260,12	14,41		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	29,16	-15,12	-21,20	9.244.073,92	1,53	659.959.524,67	1,40
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,22	0,31	1,17	3.358.506,22	0,55	185.480.342,70	1,81
Sub-total Artigo 8º III			22,36	-11,49	-16,26	12.602.580,14	2,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,32	-28,97	-33,07	122.980.724,30	20,30
---	-------	--------	--------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 2,87%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,92	2,01	14,27	2.329.762,25	0,38	9.050.054,13	25,74
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,75	7,43	13,43	10.424.235,76	1,72	124.469.195,64	8,37
Sub-total Artigo 9º A, II			23,07	5,59	13,73	12.753.998,01	2,10		

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
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26,85	0,01	1,37	4.608.445,81	0,76	809.917.545,69	0,57
Sub-total Artigo 9º A, III			26,85	0,01	1,37	4.608.445,81	0,76		
Investimentos no Exterior			23,94	2,38	6,24	17.362.443,82	2,87		
Total			9,64	-5,69	-5,59	605.901.872,32	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	428.628.566,30	70,74	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	36.930.137,90	6,10	2,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	465.558.704,20	76,84				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	23.078.884,04	3,81	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	87.299.260,12	14,41	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	12.602.580,14	2,08	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	122.980.724,30	20,30				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	12.753.998,01	2,10	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	4.608.445,81	0,76	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.362.443,82	2,87				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

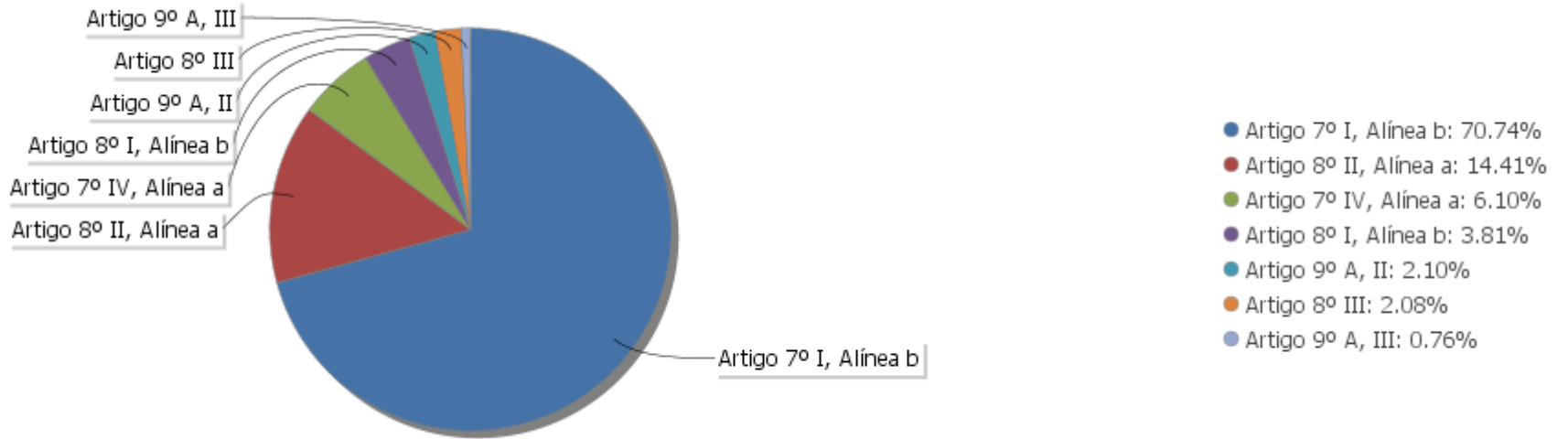
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-2,85 -841,92	-1,77 -174,97	-1,77 -174,97	0,45 19,94	9,25 170,06	-15.978.613,15	-10.355.880,08
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,12 -332,43	-0,51 -50,70	-0,51 -50,70	0,93 41,23	8,00 147,22	-432.590,49	-199.435,92
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-29,90 0,00	-36,85 0,01	-36,85 0,01	-32,20 -1,92		-457.645,13	-876.952,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-33,52 -3,61	-37,24 -0,38	-37,24 -0,38	-28,64 1,64	-17,23 6,24	-18.894.870,49	-22.883.829,76
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-11,49 18,42	-16,26 20,60	-16,26 20,60	-10,28 20,01	-4,56 18,92	-1.635.810,56	-2.447.727,52
Artigo 9º A, II % do CDI	5,59 1.651,02	13,73 1.356,95	13,73 1.356,95			1.203.630,18	1.399.716,78
Artigo 9º A, III % do CDI	0,01 1,50	1,37 135,55	1,37 135,55	5,85 258,46		233,14	-190.490,28
MOGI DAS CRUZES (Total)						-36.195.666,50	-35.554.599,52

Análise de Liquidez

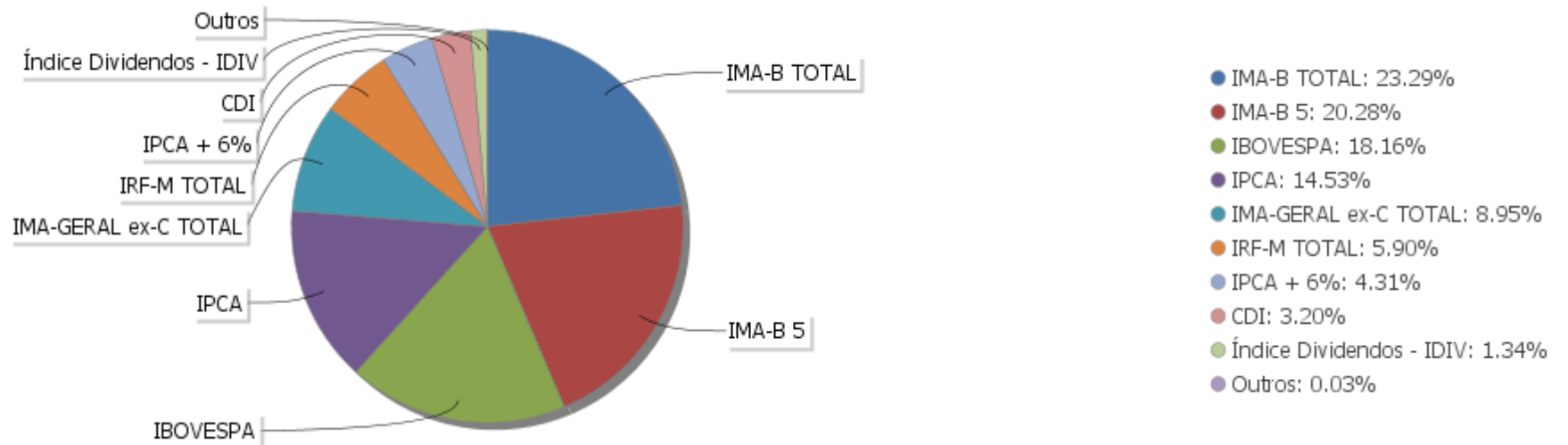
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	543.073.253,25	89,63	543.073.253,25	89,63
de 31 a 364 dias	43.012.271,93	7,10	586.085.525,18	96,73
acima de 365 dias	19.816.347,14	3,27	605.901.872,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

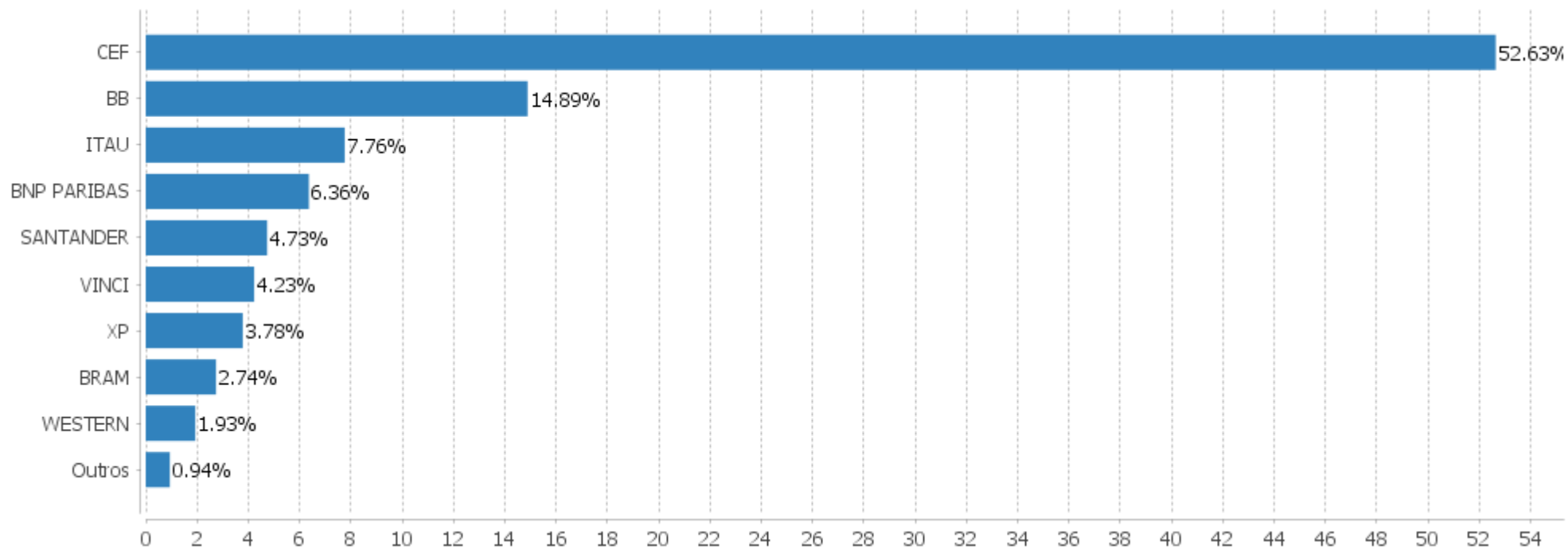


Alocação Por Estratégia



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	0,64	-0,53	-5,69										-5,59
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57										1,95
p.p. indexador	-0,07	-1,19	-6,26										-7,54
2019	2,62	0,40	0,42	1,14	1,92	2,62	1,15	-0,04	2,03	2,09	-0,62	1,88	16,71
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	1,79	-0,50	-0,77	0,09	1,28	2,17	0,42	-0,66	1,58	1,46	-1,59	0,24	6,12
2018	1,78	0,59	0,91	0,37	-1,50	0,13	1,83	-0,52	0,58	3,66	0,79	1,09	10,06
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	0,98	-0,15	0,34	-0,34	-2,38	-1,62	0,99	-0,96	-0,34	2,70	0,53	0,48	0,14

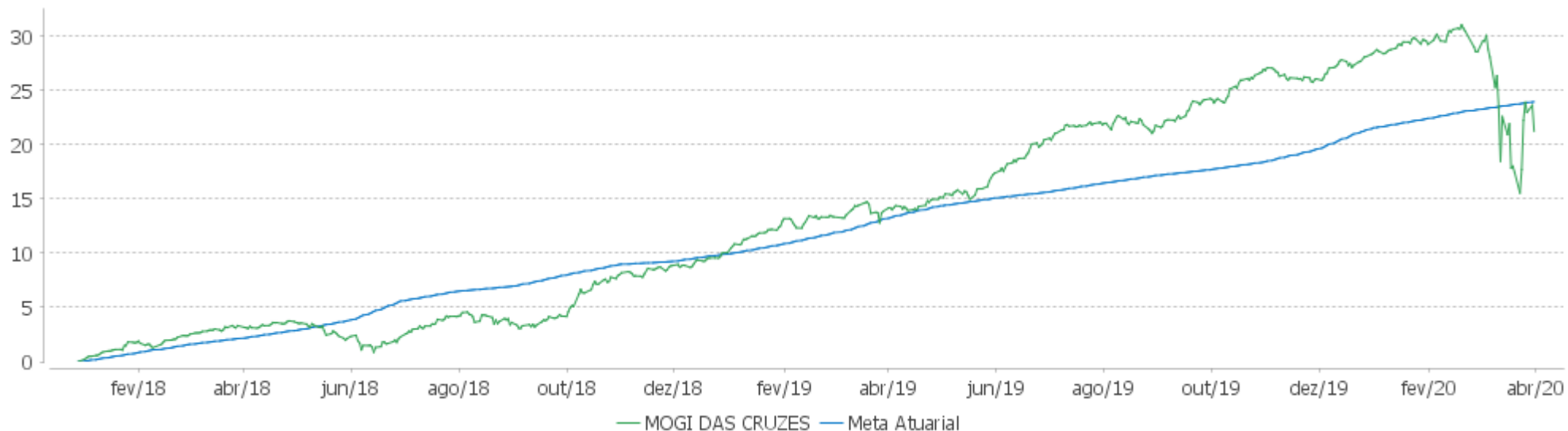
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

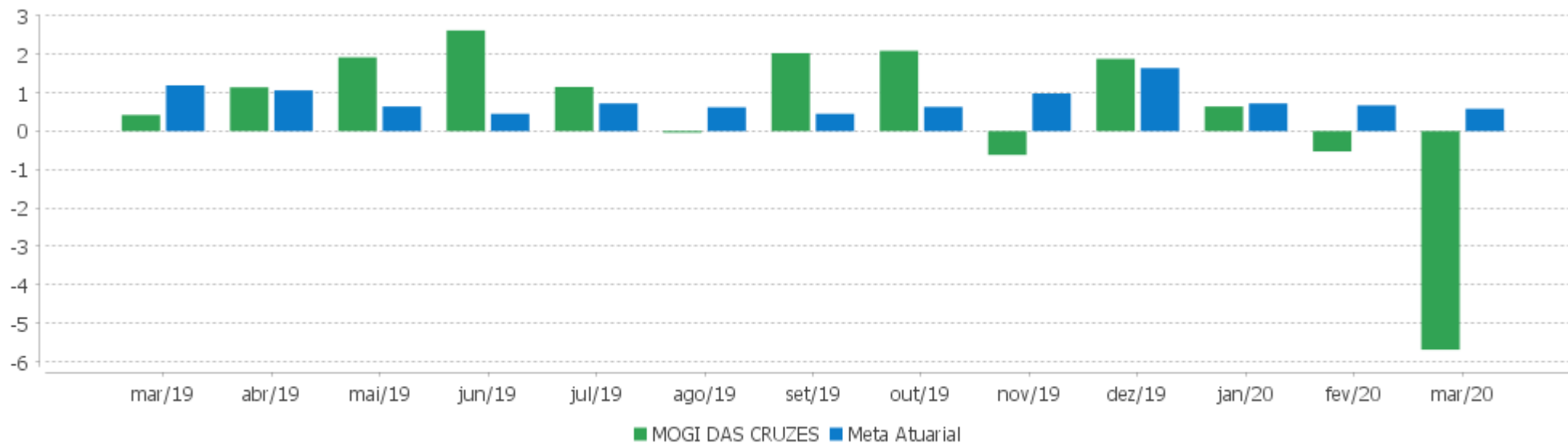
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	51,85	03 meses	-5,59	1,95	-7,54	18,73
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	48,15	06 meses	-2,41	5,30	-7,71	13,30
			12 meses	6,50	9,52	-3,02	9,64
			24 meses	17,37	21,34	-3,97	7,28
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,69	2020-03	Desde 29/12/2017	21,26	23,93	-2,66	6,90

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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF 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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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 PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI 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 PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,79 -0,04	-0,60 -0,03	-0,60 -0,03	1,92 -0,11	9,12 -0,21	18,91 -0,48	32,93 -0,74
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	-1,71 -2,40	-0,75 -2,74	-0,75 -2,74	1,75 -3,64	8,65 -0,91	28,74 7,24	40,59 9,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11 -0,01	1,36 -0,06	1,36 -0,06	3,20 -0,11	10,78 -0,31	20,64 -0,61	35,89 -0,97
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB 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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-2,10 -0,17	-1,18 -0,17	-1,18 -0,17	0,61 -0,26	8,55 0,22	18,63 0,23	30,83 -0,39
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	-1,65 -2,23	-0,46 -2,44	-0,46 -2,44	1,96 -3,37	9,42 -0,13	29,59 8,20	41,12 9,16
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,37 -0,06	1,37 -0,06	2,71 -0,13	6,42 -0,24	13,37 -0,42	23,81 -0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,13 -0,20	1,31 0,78	1,31 0,78	3,13 0,82	13,46 10,16	23,65 15,62	35,73 24,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS 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
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,17 -0,19	-6,54 -0,23	-6,54 -0,23	-3,95 -0,31	8,62 -0,52	23,20 -0,91	36,17 -1,25
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
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,40 -0,42	-6,78 -0,47	-6,78 -0,47	-4,15 -0,51	9,15 0,01	23,58 -0,53	36,56 -0,86
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	-0,07	0,58	0,58	1,69	4,81	11,43	20,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-21,48	57,61	57,61	74,75	88,50	94,27	97,16
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,53 0,46	1,13 0,60	1,13 0,60	2,34 0,03	9,75 6,45	18,58 10,56	30,29 19,37
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	-29,90 0,00	-36,85 0,01	-36,85 0,01	-30,49 -0,21	-4,30 19,17		
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
BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	0,31 92,88	1,17 115,94	1,17 115,94	2,78 122,89	7,30 134,21	11,88 98,02	25,16 116,88
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-29,79 0,12	-35,13 1,72	-35,13 1,72	-28,59 1,69	-18,70 4,77	-6,64 7,83	3,56 -8,81
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	-29,40 0,50	-33,95 2,91	-33,95 2,91	-27,42 2,87			
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-31,10 -1,20	-34,53 2,33	-34,53 2,33	-22,63 7,65	-9,40 14,07	3,86 18,32	38,10 25,73
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-27,40 -1,87	-30,98 0,25	-30,98 0,25	-22,11 -0,69	-12,36 -4,59	1,73 -3,15	22,32 -4,86
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-34,41 -4,51	-37,23 -0,37	-37,23 -0,37	-24,86 5,43	-7,53 15,94		
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-33,48 -3,57	-39,99 -3,14	-39,99 -3,14	-33,17 -2,88	-25,13 -1,65	-14,40 0,06	11,01 -1,35
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
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-39,40 -9,50	-43,18 -6,32	-43,18 -6,32	-31,25 -0,96	-16,75 6,72	-10,58 3,89	14,82 2,45
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-28,04 1,86	-30,77 6,09	-30,77 6,09	-20,58 9,71	-8,22 15,25	7,77 22,23	
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-37,91 -8,01	-39,66 -2,80	-39,66 -2,80	-29,69 0,59	-15,75 7,72	-5,17 9,29	27,56 15,20
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-31,94 -2,03	-35,94 0,91	-35,94 0,91	-26,62 3,67			
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-27,05 2,86	-34,54 2,32	-34,54 2,32	-25,80 4,49	-18,01 5,46	-0,68 13,78	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	2,01 31,92	14,27 51,13	14,27 51,13	23,40 53,68	32,83 56,31		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7,43	13,43	13,43				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6% p.p.	6,85	11,44	11,44				
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	0,01 29,91	1,37 38,23	1,37 38,23	5,85 36,14	21,73 45,20		
MOGI DAS CRUZES Var. IPCA + 6% p.p.	-5,69 -6,27	-5,59 -7,58	-5,59 -7,58	-2,41 -7,74	6,50 -3,05	17,37 -4,01	
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	6,81	15,64	15,87
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
62	03/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	758.000,00	0,00	4.112,54706500	184,3140001000
51	04/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	289.702,97	1.571,66781100	184,3283728000
52	04/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.484.297,03	13.477,56177100	184,3283728000
43	04/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	20.000,00	108,50201600	184,3283728000
47	09/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.321.000,00	0,00	23.431,87652900	184,4069123000
63	09/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	758.000,00	4.110,47498500	184,4069123000
42	09/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	391.000,00	0,00	2.120,31097500	184,4069123000
48	10/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	120.877,54	0,00	655,41421300	184,4292322000
53	11/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	29.104,23	157,78323400	184,4570508000
54	11/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	120.895,77	655,41421300	184,4570508000
82	11/03/2020	INDIE FIC FIA	1.313.000,00	0,00	425.871,58528346	3,0830890000
41	11/03/2020	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.313.000,00	0,00	2.336,36166700	561,9849095000
44	13/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.000,00	21,68480900	184,4609333000
55	18/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.825.000,00	9.887,47832500	184,5768901000
56	18/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	35.000,00	189,62287200	184,5768901000
36	18/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	67.100.000,00	30.743.544,77076700	2,1825720000
45	18/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	20.000,00	108,35592700	184,5768901000
49	19/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	53.900.000,00	0,00	292.050,74152300	184,5569702000
50	20/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	6.600.000,00	0,00	35.762,69501200	184,5498500000
57	20/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.079,46	11,26774200	184,5498500000
58	20/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	53.897.920,54	292.050,74152300	184,5498500000
37	20/03/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	6.600.000,00	0,00	8.904.407,14187400	0,7412060000
38	20/03/2020	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	6.600.000,00	0,00	5.694.009,12594371	1,1591130000
46	23/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	27.000,00	146,34932300	184,4900927000
64	23/03/2020	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	6.600.000,00	0,00	3.777.070,65165170	1,7473859000
81	23/03/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7.500.000,00	0,00	72.777,88541519	103,0532827000
39	23/03/2020	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	6.600.000,00	0,00	31.161,63597280	211,7988929000
40	23/03/2020	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.600.000,00	0,00	30.886,59198550	213,6849544000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

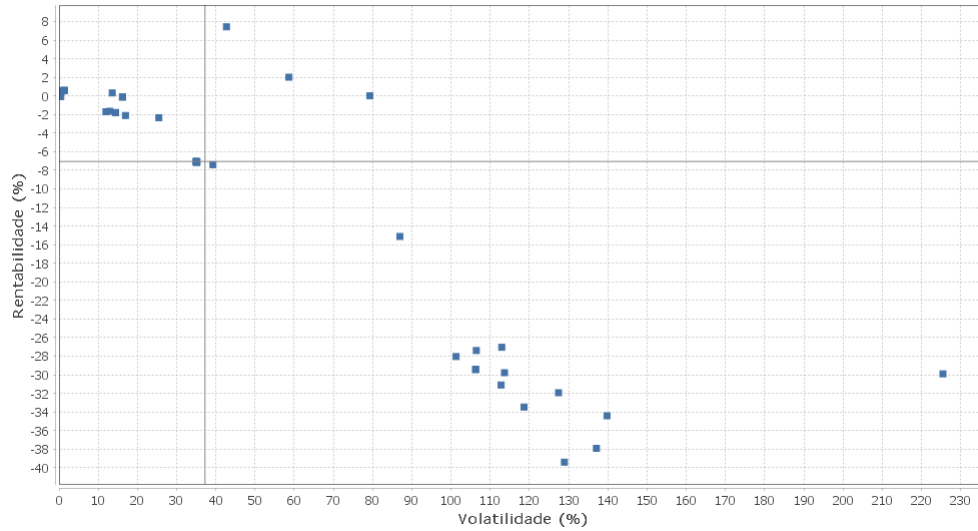
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
61	24/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	273.859,71	0,00	15.503,71209736	17,6641380000
139	24/03/2020	IT NOW IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE	19.726.140,29	0,00	278.120,00000000	70,9267233200
59	25/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.079,27	22,11756300	184,4357852000
60	25/03/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	6.595.920,73	35.762,69501200	184,4357852000
65	26/03/2020	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	6.600.000,00	0,00	8.573.110,90526980	0,7698489000

Total

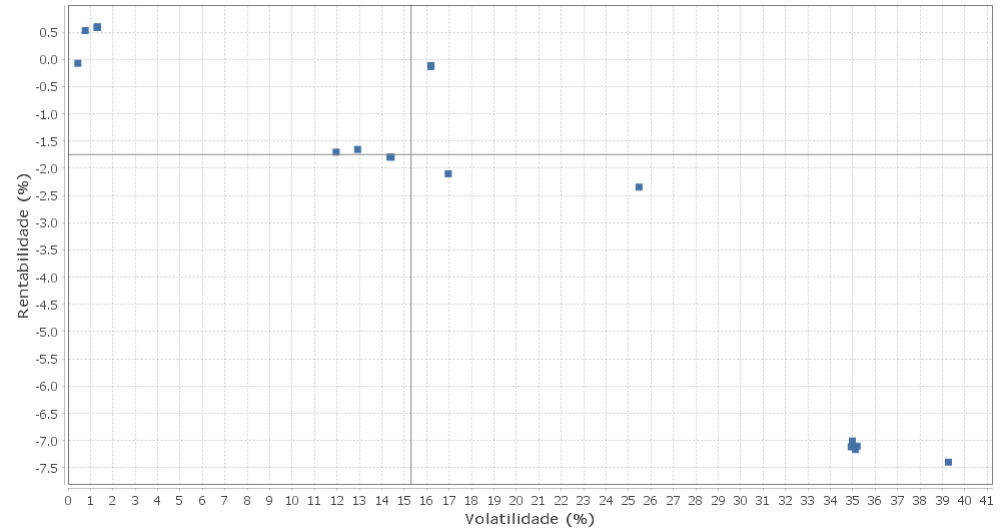
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

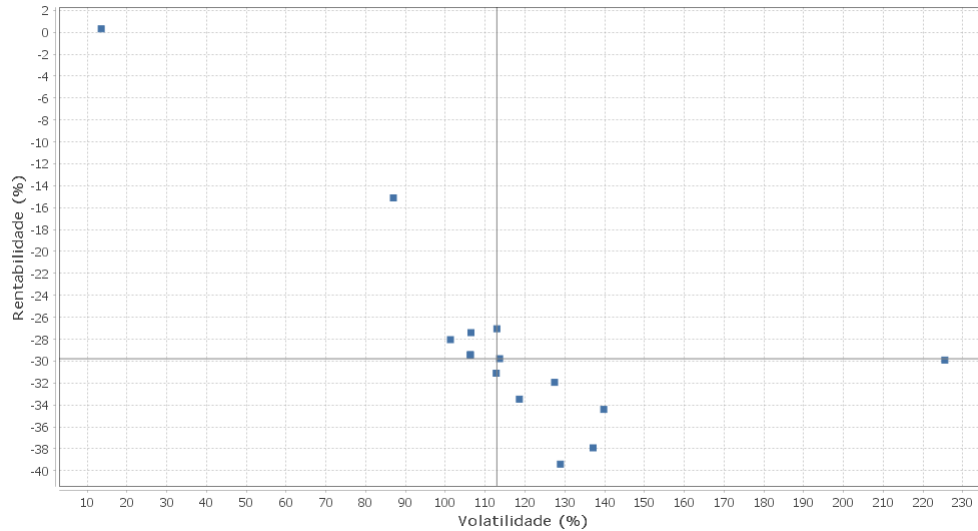
MOGI DAS CRUZES - No Mês



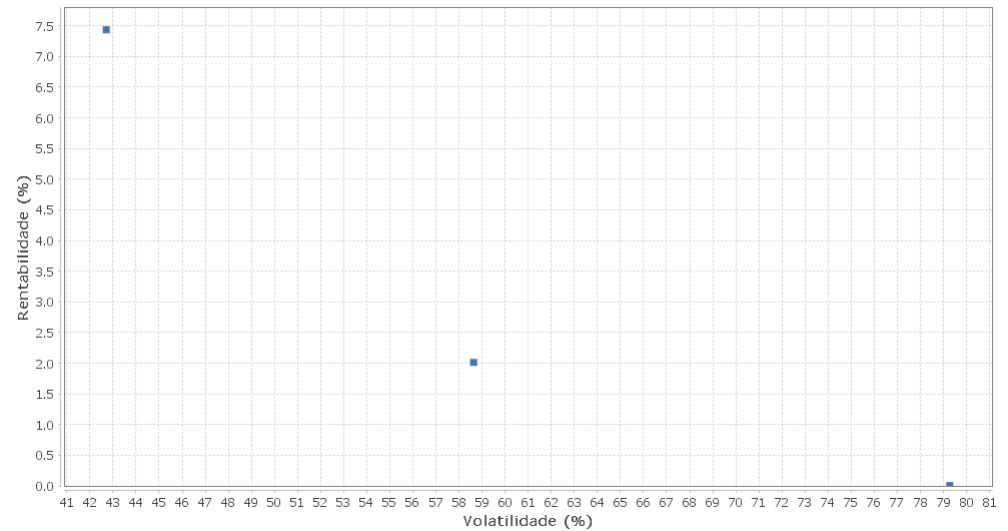
Renda Fixa - No Mês



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\$): 36.992.000,70

Value-At-Risk: 6,11%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,44	0,11	-0,00	-0,93	-0,07	6.672.408,08	1,10
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	0,02	0,00	0,25	0,53	23.375.444,55	3,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,17	0,00	0,19	0,59	77.491,60	0,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,00	0,19	0,59	15.102,97	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,21	0,00	0,20	0,60	60.515,86	0,01
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,96	1,75	0,01	-0,17	-1,71	4.306.024,92	0,71
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	12,92	2,12	0,04	-0,15	-1,65	15.510.322,22	2,56
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	13,55	1,98	0,01	-0,00	0,31	3.358.506,22	0,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	14,36	1,91	0,03	-0,15	-1,79	12.550.694,73	2,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,92	0,28	-0,15	-1,80	107.171.578,30	17,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	2,13	0,19	-0,03	-0,13	64.058.224,75	10,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	16,19	2,13	0,11	-0,03	-0,11	35.494.268,06	5,86
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	16,96	2,05	0,16	-0,14	-2,10	53.847.852,16	8,89
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	25,47	3,42	0,01	-0,11	-2,35	2.328.868,10	0,38
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	34,93	3,98	0,01	-0,21	-7,12	1.463.844,48	0,24
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	34,98	4,04	0,08	-0,21	-7,01	13.067.934,77	2,16
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	35,12	4,04	0,11	-0,21	-7,17	18.668.176,89	3,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	4,07	0,61	-0,21	-7,10	101.471.510,97	16,75
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	39,27	4,42	0,04	-0,20	-7,40	5.418.440,79	0,89
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	42,71	11,24	0,07	0,17	7,43	10.424.235,76	1,72
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	58,63	13,75	0,03	0,03	2,01	2.329.762,25	0,38
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	79,27	21,51	0,12	-0,00	0,01	4.608.445,81	0,76
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	86,96	19,36	0,26	-0,18	-15,12	9.244.073,92	1,53
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	101,27	25,62	0,43	-0,28	-28,04	10.330.036,54	1,70
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	106,26	29,70	0,03	-0,28	-29,46	609.811,78	0,10
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	106,27	29,70	0,30	-0,28	-29,40	6.237.167,94	1,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	106,44	27,84	0,36	-0,26	-27,40	8.049.739,10	1,33
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	112,77	27,86	0,31	-0,28	-31,10	6.937.227,69	1,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	112,93	29,97	0,07	-0,24	-27,05	1.463.495,23	0,24
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	113,63	26,26	0,79	-0,27	-29,79	18.773.733,49	3,10
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	118,60	30,92	0,15	-0,29	-33,48	3.008.275,11	0,50
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	127,42	28,68	0,30	-0,25	-31,94	7.048.514,99	1,16
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	128,91	27,81	0,51	-0,31	-39,40	11.565.131,27	1,91
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	137,09	30,27	0,59	-0,28	-37,91	12.226.572,93	2,02
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	139,78	30,71	0,05	-0,25	-34,41	1.049.554,05	0,17
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	225,45	14,12	0,05	-0,13	-29,90	23.078.884,04	3,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

- Referente ao mês de março de 2020, vale observar que o Instituto está com 25,74% do patrimônio líquido do fundo ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (Art. 9 A, Inciso II), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Saliemos também que de acordo com informações provenientes da Nota Técnica nº 12/2017/CGAI/SRPPS/SPREV-ME, versão 09 de 17/09/2019, mais especificamente a questão de número 59, existe o entendimento de que para a verificação do limite máximo de alocação no segmento de investimentos no exterior, dispostos no art. 9º-A, considera-se o patrimônio líquido do fundo constituído no exterior.