



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
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 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 85,35%

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	0,26	0,42	0,42	59.944,79	0,01	7.374.284.212,96	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,90	0,24	0,24	13.993.124,64	2,19	736.673.993,30	1,90
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,91	0,25	0,25	108.751.771,55	16,99	6.604.088.892,56	1,65
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,42	0,42	14.962,41	0,00	213.228.052,83	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,42	0,42	76.759,93	0,01	10.529.932.746,92	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,97	0,54	0,54	108.450.093,14	16,94	9.706.276.068,00	1,12
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	4,90	0,24	0,24	20.023.696,47	3,13	1.294.763.175,70	1,55
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,10	0,84	0,84	103.911.829,19	16,23	15.527.608.259,67	0,67
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,15	0,90	0,90	2.360.627,98	0,37	521.981.921,31	0,45
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,56	0,56	12.696.993,39	1,98	4.489.872.848,79	0,28
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	2,08	0,55	0,55	16.070.869,93	2,51	529.547.773,86	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,35	0,49	0,49	54.753.942,42	8,55	10.446.730.359,40	0,52
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,67	0,82	0,82	63.748.651,33	9,96	10.136.705.212,45	0,63
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,85	0,42	0,42	4.470.221,55	0,70	898.056.727,55	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,73	0,55	0,55	509.383.488,72	79,57		

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	6.660.458,14	1,04	4.320.739.663,56	0,15
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	5,40	0,27	0,27	5.828.231,50	0,91	383.800.990,07	1,52
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,89	0,26	0,26	1.569.673,42	0,25	1.618.694.263,00	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,87	0,34	0,34	22.920.132,71	3,58	5.214.674.759,25	0,44
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,84	0,33	0,33	36.978.495,77	5,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,66

0,53

0,53

546.361.984,49

85,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,66%

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	35,08	-1,64	-1,64	4.160.197,19	0,65	7.417.494.440,63	0,06
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			35,08	-1,64	-1,64	4.160.197,19	0,65		

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	17,35	-0,66	-0,66	4.980.272,22	0,78	767.681.560,64	0,65
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,68	0,62	0,62	929.563,31	0,15	2.139.496.712,77	0,04
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	16,36	2,02	2,02	7.054.164,24	1,10	748.602.029,25	0,94
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,31	-0,77	-0,77	17.164.120,70	2,68	343.967.867,69	4,99
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	17,47	3,25	3,25	20.921.910,04	3,27	796.574.798,64	2,63
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	17,42	-1,44	-1,44	1.694.015,43	0,26	828.085.660,89	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,73	1,53	1,53	11.842.066,55	1,85	943.947.729,59	1,25
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	14,65	2,32	2,32	3.603.609,84	0,56	175.442.532,41	2,05
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,57	1,28	1,28	68.189.722,33	10,65		

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	12,58	0,37	0,37	11.773.822,83	1,84	848.907.600,44	1,39
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	1,66	0,52	0,52	3.336.952,47	0,52	175.155.033,29	1,91
Sub-total Artigo 8º III			9,47	0,40	0,40	15.110.775,30	2,36		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

12,74 0,97 0,97 87.460.694,82 13,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,99%

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	15,54	8,87	8,87	918.929,88	0,14	19.154.683,27	4,80
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,28	8,81	8,81	1.846.814,27	0,29	59.218.698,09	3,12
Sub-total Artigo 9º A, II			12,56	8,83	8,83	2.765.744,15	0,43		

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	12,24	6,97	6,97	3.568.997,21	0,56	768.827.860,05	0,46
Sub-total Artigo 9º A, III			12,24	6,97	6,97	3.568.997,21	0,56		
Investimentos no Exterior			13,00	7,74	7,74	6.334.741,36	0,99		
Total			3,29	0,64	0,64	640.157.420,67	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	509.383.488,72	79,57	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	36.978.495,77	5,78	2,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	546.361.984,49	85,35				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	4.160.197,19	0,65	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	68.189.722,33	10,65	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.110.775,30	2,36	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	87.460.694,82	13,66				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	2.765.744,15	0,43	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	3.568.997,21	0,56	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	6.334.741,36	0,99				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

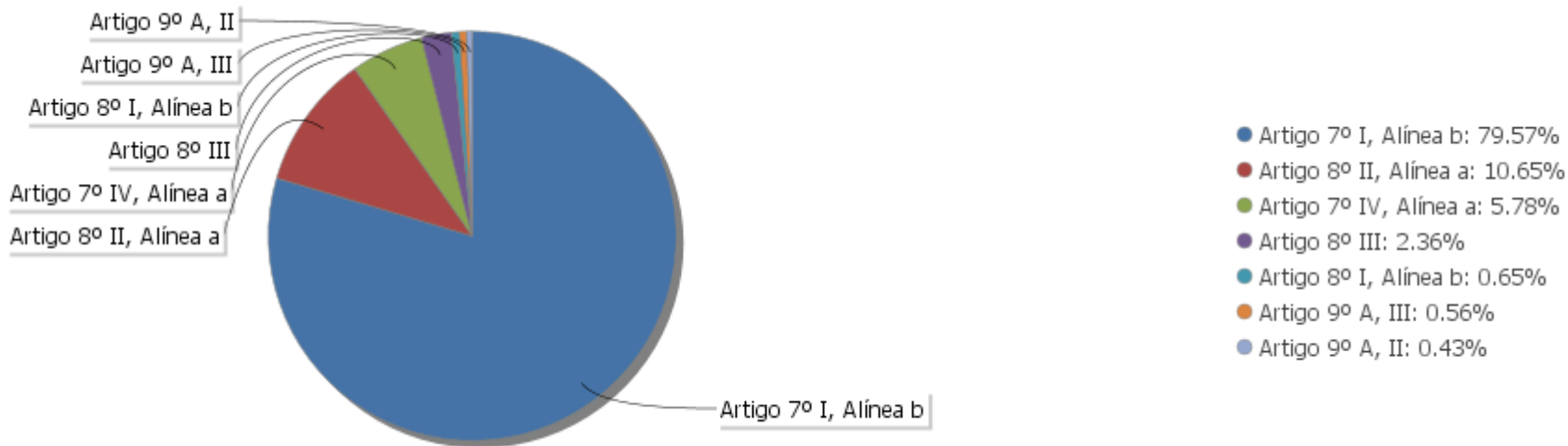
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,55 145,70	0,55 145,70	0,66 58,28	4,78 183,64	12,88 222,72	2.779.965,06	2.779.965,06
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,33 87,46	0,33 87,46	0,77 67,97	3,12 119,93	9,70 167,74	125.659,20	125.659,20
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,64 -0,01	-1,64 -0,01	3,56 -2,55	7,77 -3,97		-69.499,30	-69.499,30
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,28 2,91	1,28 2,91	12,29 6,19	19,25 7,51	31,12 14,31	794.709,73	794.709,73
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,40 2,03	0,40 2,03	5,68 -0,42	8,69 -3,04	19,07 2,27	60.467,64	60.467,64
Artigo 9º A, II % do CDI	8,83 2.345,22	8,83 2.345,22				224.462,92	224.462,92
Artigo 9º A, III % do CDI	6,97 1.849,84	6,97 1.849,84	12,58 1.107,47	18,97 728,60		128.061,12	128.061,12
MOGI DAS CRUZES (Total)						4.043.826,37	4.043.826,37

Análise de Liquidez

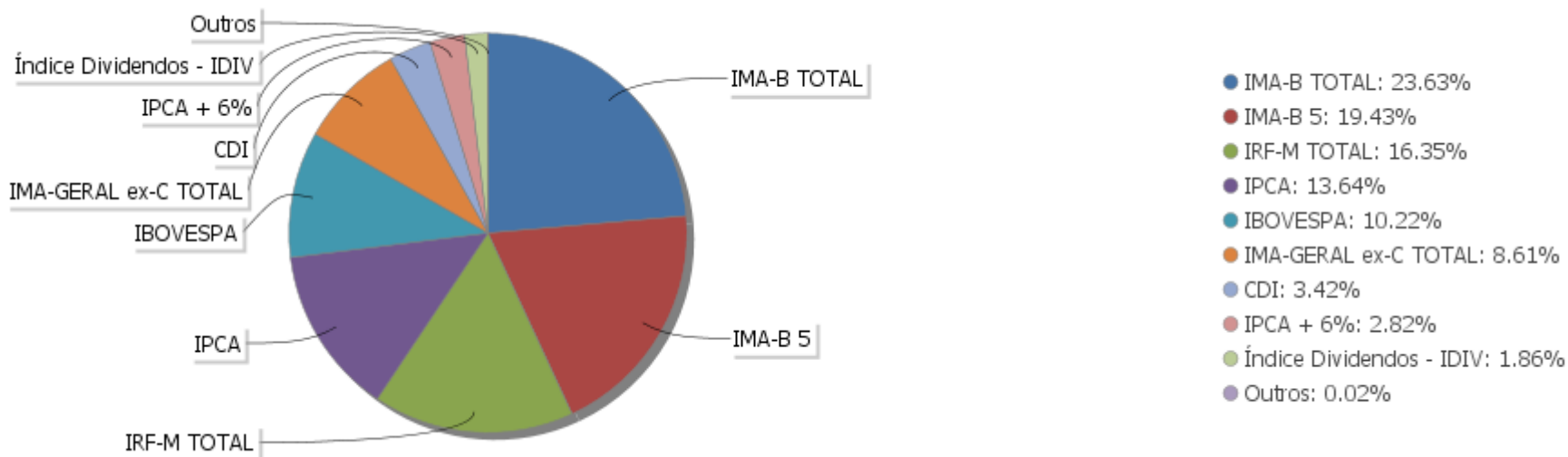
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	585.158.337,17	91,41	585.158.337,17	91,41
de 31 a 364 dias	34.457.992,02	5,38	619.616.329,19	96,79
acima de 365 dias	20.541.091,48	3,21	640.157.420,67	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

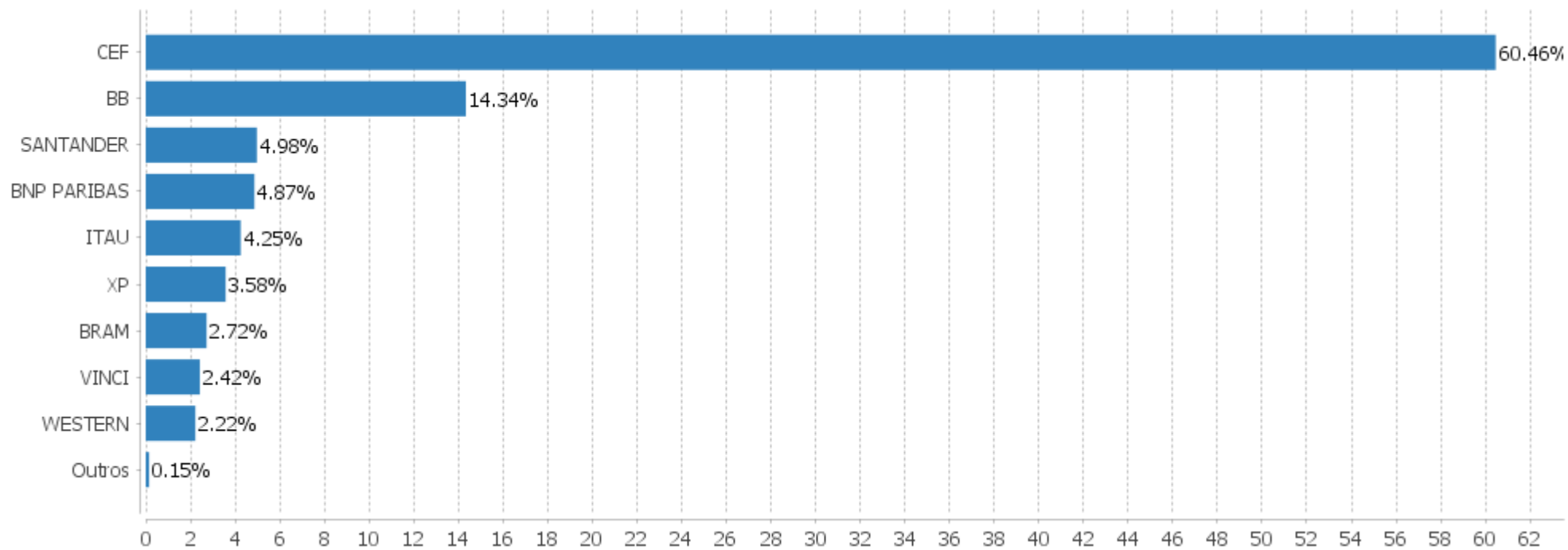


Alocação Por Estratégia



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												0,64
IPCA + 5,86%	0,71												0,71
p.p. indexador	-0,07												-0,07
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

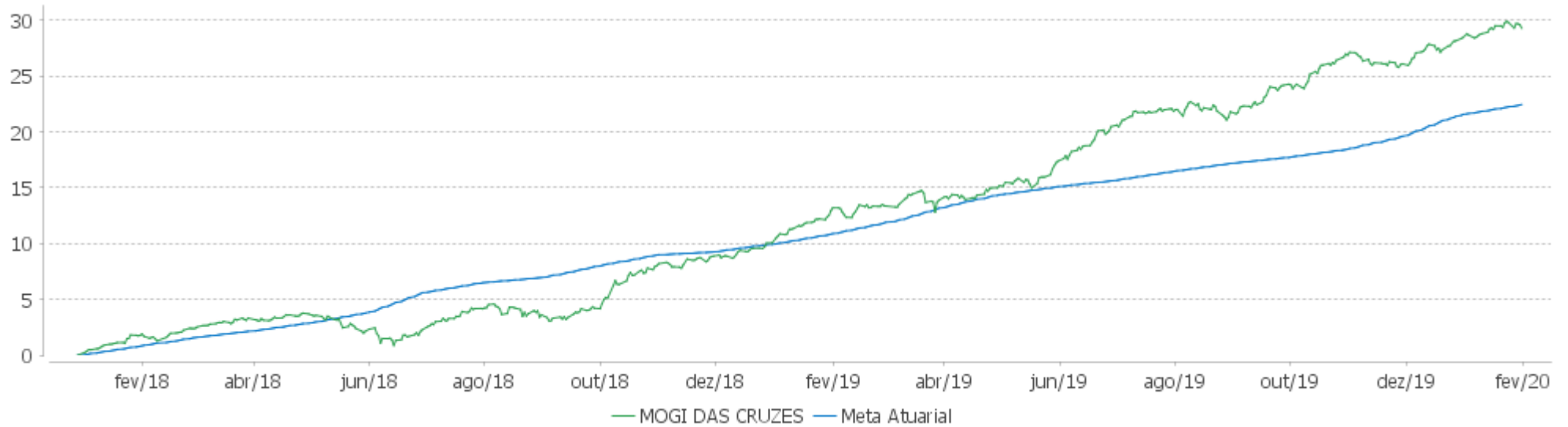
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

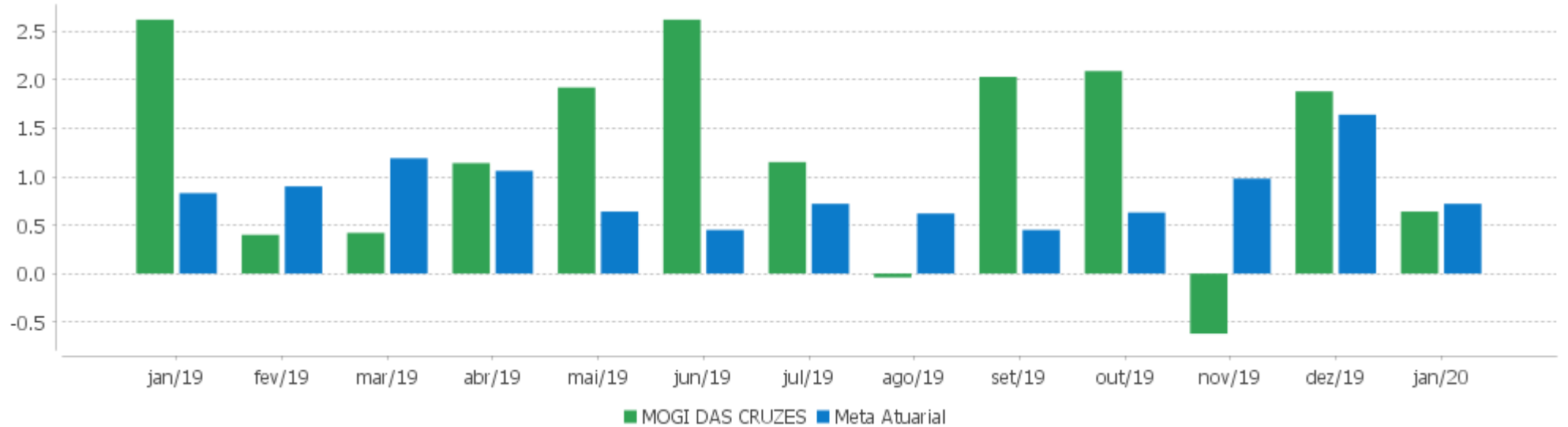
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	56,00	03 meses	1,90	3,36	-1,46	2,78
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	44,00	06 meses	6,10	5,13	0,97	3,15
			12 meses	14,46	10,46	4,00	3,29
			24 meses	27,01	21,45	5,56	3,24
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10	Desde 29/12/2017	29,27	22,42	6,84	3,20
Menor rentabilidade da Carteira	-1,50	2018-05					

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
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
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,27 0,01	0,27 0,01	-0,47 -0,23	5,62 -0,02	18,52 0,41	34,95 0,16	54,21 -0,11
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,34 0,13	0,34 0,13	1,04 -0,84	2,66 0,60	9,69 5,50	19,74 11,62	34,32 23,11
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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,90 0,35	0,90 0,35	1,29 -0,22	5,76 0,72	14,49 2,43	28,70 5,33	46,99 7,86
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,01	0,54 -0,01	1,41 -0,10	4,89 -0,15	11,76 -0,30	22,83 -0,53	38,27 -0,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI 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
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,56 -0,00	0,56 -0,00	1,44 -0,07	4,92 -0,12	11,82 -0,24	22,86 -0,50	38,36 -0,77
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,42 -0,28	0,42 -0,28	1,47 -1,98	4,59 -0,57	11,28 0,69	32,08 10,73	44,58 13,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,84 -0,04	0,84 -0,04	0,96 -0,08	4,33 -0,17	11,12 -0,35	22,99 -0,54	39,91 -1,04
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,03	0,24 -0,03	-0,31 -0,07	5,48 -0,16	17,72 -0,39	33,86 -0,92	52,51 -1,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,49 -0,01	0,49 -0,01	0,50 -0,21	3,93 -0,15	11,38 0,31	22,76 0,53	37,70 -0,16
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,55 -0,17	0,55 -0,17	1,46 -1,92	4,79 -0,35	11,93 1,46	32,69 11,23	44,78 12,45
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,14 -0,06	2,92 -0,13	6,36 -0,25	13,63 -0,40	25,33 -0,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	0,82 0,61	0,91 -0,97	4,67 2,62	14,10 9,91	25,30 17,17	39,15 27,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,42	1,14	2,93	6,40	13,64	25,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,02	-0,05	-0,11	-0,22	-0,40	-0,64
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,02	0,24 -0,02	-0,30 -0,07	5,50 -0,14	17,78 -0,34	34,07 -0,72	53,21 -1,11
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	0,37 97,48	0,37 97,48	6,95 611,37	10,06 386,20	23,30 402,85	22,94 183,05	64,36 278,76
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	0,52 139,18	0,52 139,18	1,45 127,63	3,39 130,37	7,01 121,22	13,42 107,08	28,19 122,08
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	-1,64 -0,01	-1,64 -0,01	6,17 0,07	10,49 -1,25	49,05 32,25		
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-0,77 0,86	-0,77 0,86	6,44 0,34	13,17 1,43	22,79 5,98	41,50 7,53	59,91 -16,00
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,53 3,11	1,53 3,11	10,76 -0,03	17,94 0,79	28,52 1,51	51,11 0,35	85,98 -5,16
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-0,66 0,97	-0,66 0,97	8,58 2,48	14,32 2,58	21,35 4,55	41,20 7,23	90,90 14,99
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	2,02 3,65	2,02 3,65	20,98 14,88	27,18 15,44	46,35 29,54	57,43 23,46	115,00 39,09
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,25 4,88	3,25 4,88	17,74 11,64	24,95 13,21	40,12 23,31	70,96 36,99	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,62 2,25	0,62 2,25	8,68 2,58	15,29 3,55	27,77 10,96	60,37 26,40	104,20 28,29
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,32 3,95	2,32 3,95	14,38 8,28	19,29 7,55	32,86 16,05	59,65 25,68	
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,44 0,19	-1,44 0,19	10,33 4,23	13,10 1,37	20,92 4,12	48,45 14,47	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	8,87 10,50	8,87 10,50	17,10 11,00	23,18 11,45	42,71 25,90		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	8,81 8,09	8,81 8,09					
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	6,97 8,60	6,97 8,60	12,58 6,48	18,97 7,24	44,46 27,66		
MOGI DAS CRUZES Var. IPCA + 6% p.p.	0,64 -0,08	0,64 -0,08	1,90 -1,48	6,10 0,95	14,46 3,99	27,01 5,55	
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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	7,81	15,07	14,60
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

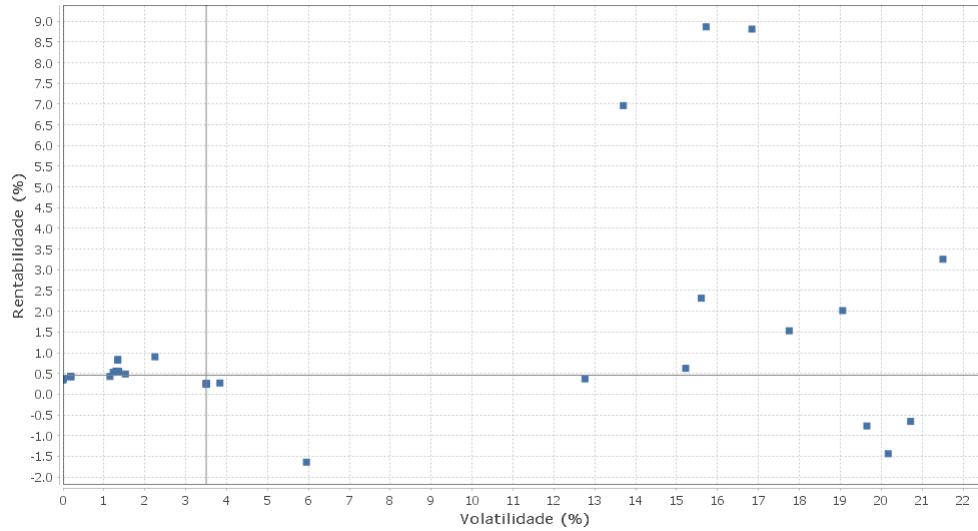
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	03/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	20.000,00	109,22069700	183,1154776000
2	03/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.740.000,00	14.963,23541800	183,1154776000
3	03/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	769.000,00	0,00	4.199,53578000	183,1154776000
4	09/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	416.000,00	0,00	2.270,23110200	183,2412567000
5	09/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	5.948.000,00	0,00	32.459,93892000	183,2412567000
6	09/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	769.000,00	4.196,65316600	183,2412567000
7	15/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	18.000,00	98,16367900	183,3672115000
8	16/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.859.000,00	10.136,35974300	183,3991736000
9	22/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	65.000,00	354,18234600	183,5212874000
10	22/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.800.000,00	9.808,12648800	183,5212874000
11	23/01/2020	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	450.000,00	0,00	148.580,47207510	3,0286618000
12	23/01/2020	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	450.000,00	0,00	1.016,14072770	442,8520457000
13	23/01/2020	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	900.000,00	0,00	2.068,09854656	435,1823570000
14	30/01/2020	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	257.000,00	0,00	86.951,04077850	2,9556863000
15	30/01/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.000,00	5,44341600	183,7082004000
16	30/01/2020	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	257.000,00	0,00	606,29053250	423,8891855000
17	30/01/2020	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	514.000,00	0,00	1.173,29551469	438,0823020000
Total						

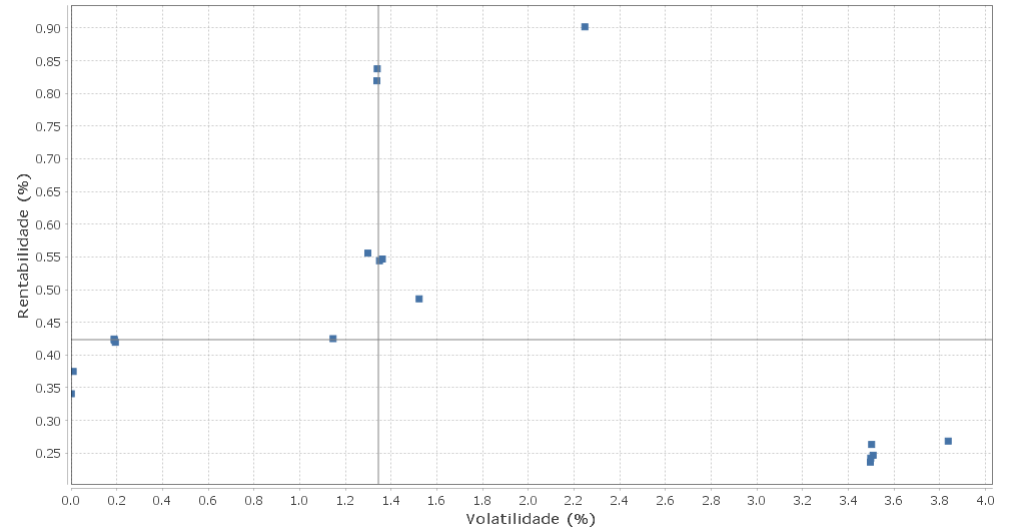
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

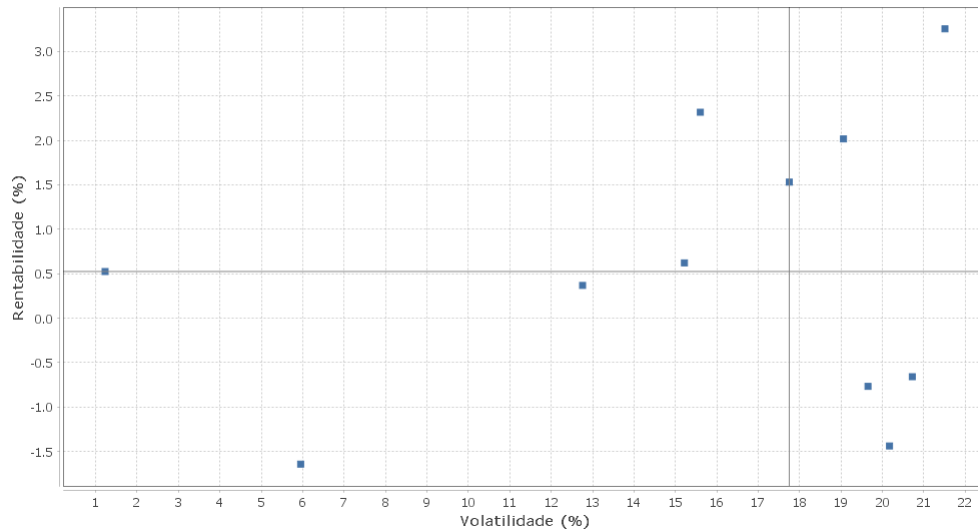
MOGI DAS CRUZES - No Mês



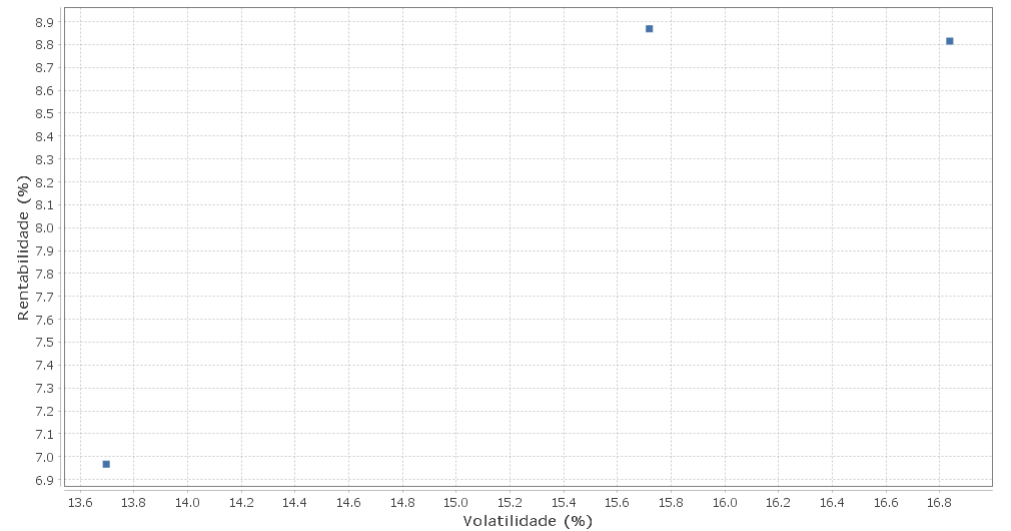
Renda Fixa - No Mês



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\$): 9.099.591,00

Value-At-Risk: 1,42%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,14	0,00	-38,86	0,34	22.920.132,71	3,58
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-0,20	0,37	6.660.458,14	1,04
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,10	0,00	0,25	0,42	14.962,41	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,11	0,00	0,24	0,42	76.759,93	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,10	0,00	0,22	0,42	59.944,79	0,01
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,15	0,74	0,00	0,04	0,42	4.470.221,55	0,70
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	1,23	0,75	0,00	0,12	0,52	3.336.952,47	0,52
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,83	0,01	0,14	0,56	12.696.993,39	1,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	1,10	0,09	0,33	0,82	63.748.651,33	9,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,97	0,13	0,34	0,84	103.911.829,19	16,23
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,81	0,10	0,12	0,54	108.450.093,14	16,94
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,81	0,01	0,12	0,55	16.070.869,93	2,51
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	1,04	0,08	0,07	0,49	54.753.942,42	8,55
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,25	1,39	0,00	0,23	0,90	2.360.627,98	0,37
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	3,50	2,34	0,04	-0,04	0,24	13.993.124,64	2,19
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,50	2,34	0,06	-0,04	0,24	20.023.696,47	3,13
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	3,50	2,33	0,00	-0,03	0,26	1.569.673,42	0,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	2,37	0,34	-0,04	0,25	108.751.771,55	16,99
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	3,84	2,60	0,02	-0,03	0,27	5.828.231,50	0,91
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	5,95	16,36	-0,00	-0,34	-1,64	4.160.197,19	0,65
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	12,76	4,94	0,04	-0,00	0,37	11.773.822,83	1,84
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	13,70	6,37	0,01	0,48	6,97	3.568.997,21	0,56
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,22	6,95	0,01	0,02	0,62	929.563,31	0,15
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,60	5,37	0,02	0,12	2,32	3.603.609,84	0,56
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	15,72	6,98	0,00	0,54	8,87	918.929,88	0,14
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,84	6,15	-0,00	0,50	8,81	1.846.814,27	0,29
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	17,75	6,02	0,07	0,06	1,53	11.842.066,55	1,85
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	19,06	7,37	0,05	0,09	2,02	7.054.164,24	1,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	19,65	5,74	0,10	-0,06	-0,77	17.164.120,70	2,68
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,17	6,70	0,01	-0,09	-1,44	1.694.015,43	0,26
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	20,72	6,41	0,03	-0,05	-0,66	4.980.272,22	0,78
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,51	7,01	0,16	0,13	3,25	20.921.910,04	3,27