



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
DEZEMBRO 2019



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 18.09.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

85,82%

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	0,40	6,49	59.694,47	0,01	7.033.827.032,81	0,00
BRAM	BRDESCO	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,93	1,98	22,53	13.960.159,26	2,20	740.920.894,31	1,88
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,99	22,59	108.484.183,39	17,13	6.698.026.543,95	1,62
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,40	6,51	14.899,19	0,00	214.846.483,77	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,40	6,55	76.436,93	0,01	10.910.469.036,62	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,98	1,21	12,85	107.863.207,32	17,03	9.819.854.122,58	1,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	4,93	1,98	22,58	19.975.314,96	3,15	1.008.932.506,25	1,98
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,16	0,61	11,68	103.048.685,16	16,27	14.821.342.261,54	0,70
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,20	1,40	15,95	2.339.530,69	0,37	537.480.070,49	0,44
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,98	1,19	12,89	12.626.808,58	1,99	4.389.106.279,05	0,29
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	2,13	1,12	13,34	15.983.483,66	2,52	526.668.327,49	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,37	0,96	13,07	54.489.211,68	8,60	9.800.245.404,11	0,56
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,76	0,59	16,43	63.230.602,44	9,98	9.818.666.120,10	0,64
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,89	1,09	12,68	4.451.305,93	0,70	894.256.625,28	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,74	1,20	14,58	506.603.523,66	79,98		

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	0,06	0,37	5,81	6.771.355,13	1,07	4.076.826.633,95	0,17
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	5,43	2,15	23,61	5.812.632,09	0,92	424.021.068,28	1,37
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,92	2,01	22,56	1.565.554,38	0,25	1.647.184.690,31	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,01	0,34	11,91	22.842.294,97	3,61	5.156.074.278,85	0,44
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,93	0,72	11,71	36.991.836,57	5,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,67

1,17

14,37

543.595.360,23

85,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,46%

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	35,03	1,51	1,51	4.229.696,49	0,67	7.309.008.498,93	0,06
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			35,03	4,29	8,35	4.229.696,49	0,67		

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	17,02	7,81	32,92	5.013.352,20	0,79	777.293.295,00	0,64
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,58	7,51	8,69	923.826,46	0,15	2.163.582.480,78	0,04
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	15,88	13,14	58,00	6.249.581,50	0,99	447.002.800,14	1,40
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	13,99	6,70	41,91	17.297.053,16	2,73	339.460.454,72	5,10
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	16,92	9,96	49,33	20.262.491,41	3,20	772.724.746,10	2,62
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	17,19	1,76	1,76	1.718.752,21	0,27	759.876.805,11	0,23
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	15,43	8,52	42,07	11.663.690,86	1,84	842.981.450,04	1,38
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	14,54	9,03	17,50	2.852.264,80	0,45	164.956.232,10	1,73
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,16	8,75	43,67	65.981.012,60	10,42		

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	12,91	2,62	32,29	11.730.755,26	1,85	804.084.944,48	1,46
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	1,66	0,93	7,82	3.319.552,40	0,52	172.102.443,20	1,93
Sub-total Artigo 8º III			9,60	2,24	25,38	15.050.307,66	2,38		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

12,25 7,43 39,01 85.261.016,75 13,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,72%

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	16,87	-2,06	2,94	844.073,83	0,13	17.297.605,55	4,88
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	10,32	0,49	0,49	1.697.207,40	0,27	43.282.963,52	3,92
Sub-total Artigo 9º A, II			10,52	-2,27	2,72	2.541.281,23	0,40		

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 CONS AMERICANO PB FI ACOES	12,85	-1,22	11,61	2.026.936,09	0,32	647.174.574,06	0,31
Sub-total Artigo 9º A, III			12,85	-1,22	11,61	2.026.936,09	0,32		
Investimentos no Exterior			12,86	-1,54	11,78	4.568.217,32	0,72		
Total						633.424.594,30	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	506.603.523,66	79,98	30,00	55,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	36.991.836,57	5,84	10,00	14,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	543.595.360,23	85,82				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	4.229.696,49	0,67	0,00	2,00	10,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	65.981.012,60	10,42	0,00	9,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.050.307,66	2,38	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	85.261.016,75	13,46				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	2.541.281,23	0,40	0,00	1,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	2.026.936,09	0,32	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.568.217,32	0,72				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

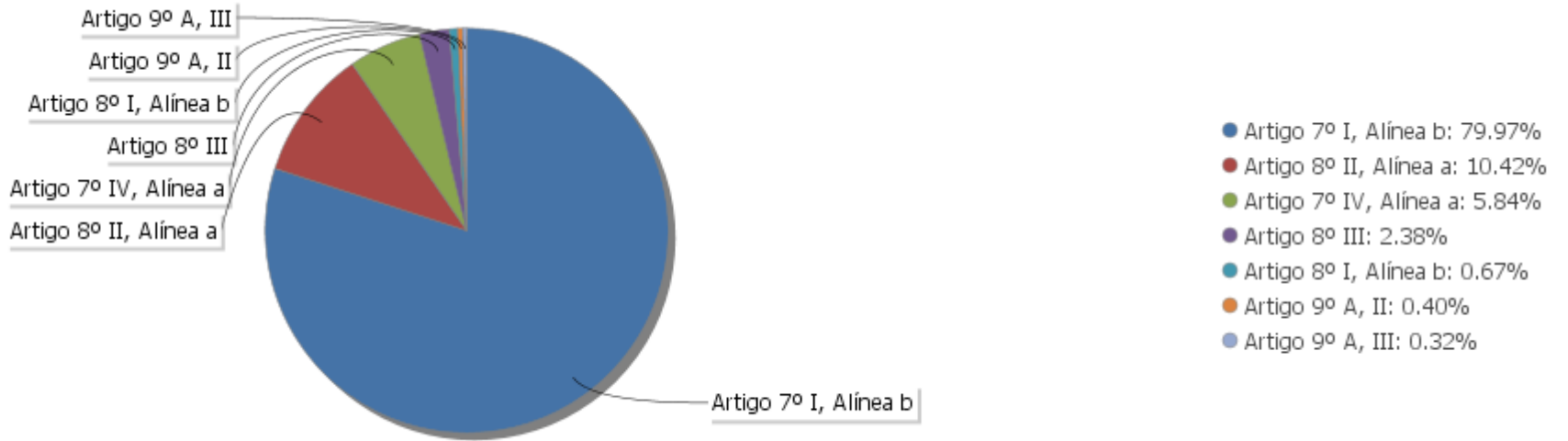
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,20 319,09	14,58 244,70	2,26 182,54	5,32 189,92	14,58 244,70	5.985.563,52	64.516.051,28
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,72 191,20	11,71 196,43	1,45 117,32	3,74 133,62	11,71 196,43	257.199,70	4.093.751,59
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,84 14,06	0,00 0,00	0,00 0,00	0,84 14,06	0,00	10.501,51
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	4,29 -2,55	8,35 -3,00	7,36 -3,05			174.096,99	325.865,23
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,75 1,90	43,67 12,08	13,70 3,29	20,45 5,92	43,67 12,08	4.885.035,27	16.136.757,98
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,24 -4,61	25,38 -6,20	7,14 -3,26	9,56 -4,98	25,38 -6,20	329.796,85	3.124.265,57
Artigo 9º A, II % do CDI	-2,27 -604,64	2,72 436,62				-9.538,62	32.281,23
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,22 -325,75	11,61 451,47	4,42 356,55			-25.045,62	210.885,25
						11.597.108,09	88.450.359,64

Análise de Liquidez

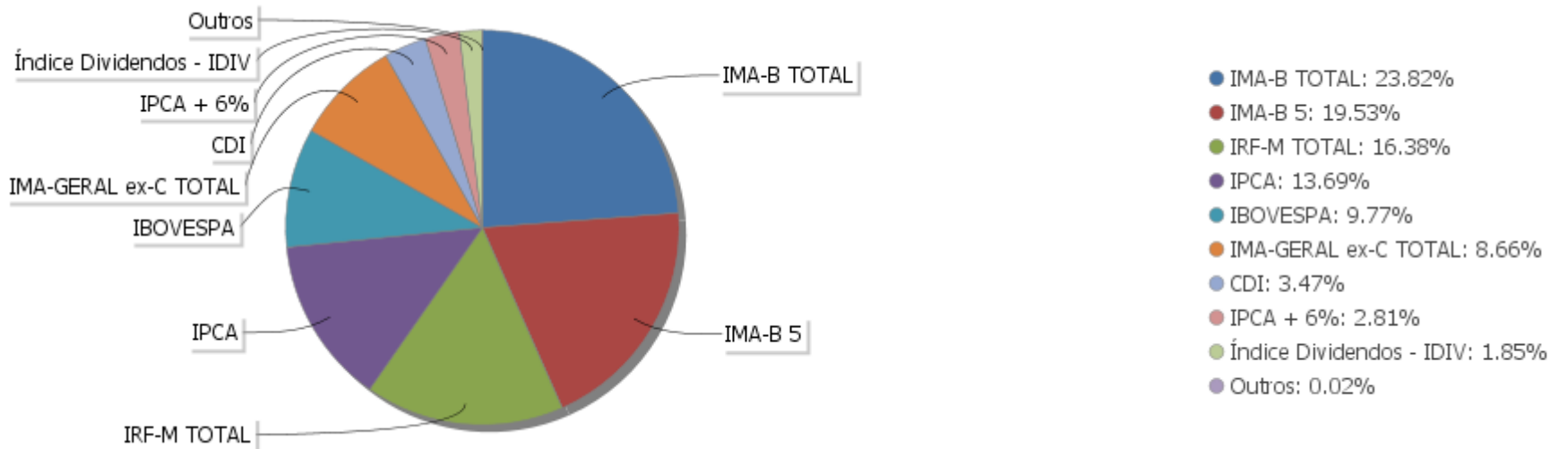
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	579.344.870,23	91,46	579.344.870,23	91,46
de 31 a 364 dias	33.644.934,48	5,31	612.989.804,71	96,77
acima de 365 dias	20.434.789,59	3,23	633.424.594,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

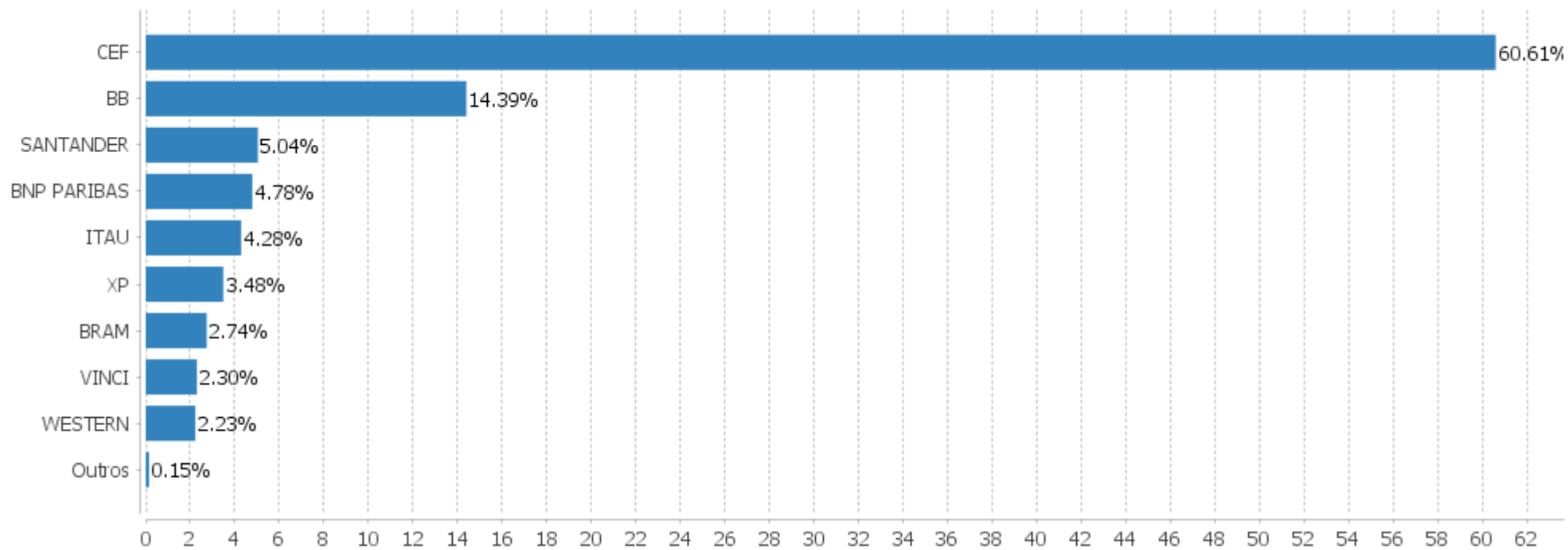


Alocação Por Estratégia



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
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

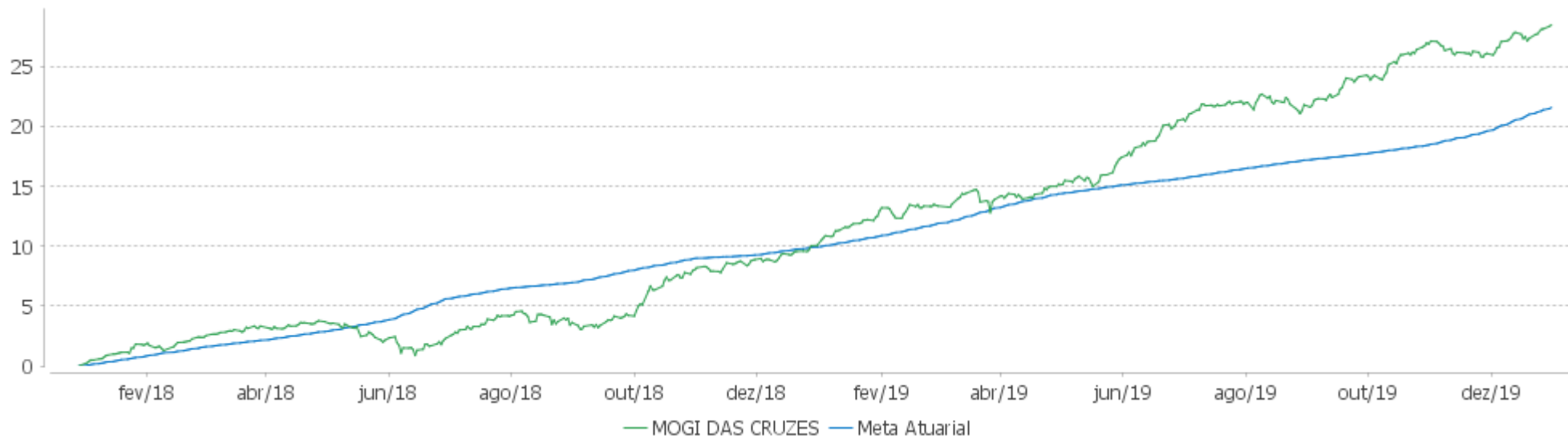
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

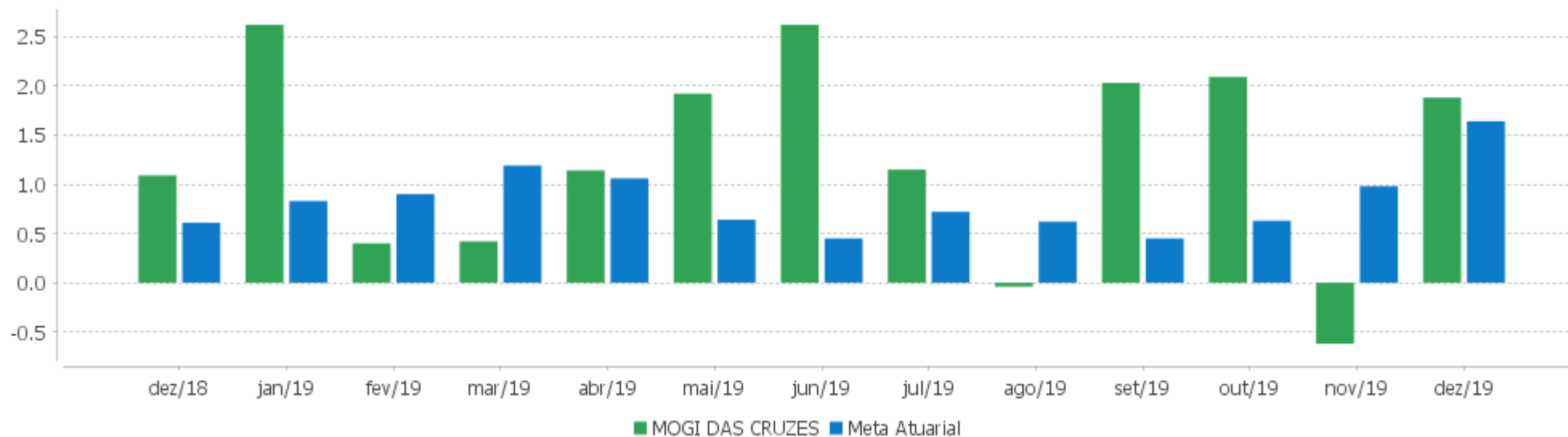
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	58,33	03 meses	3,37	3,28	0,09	2,90
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	41,67	06 meses	6,63	5,15	1,49	3,06
			12 meses	16,71	10,59	6,12	3,26
			24 meses	28,45	21,56	6,89	3,21
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,50	2018-05	Desde 29/12/2017	28,45	21,56	6,89	3,21

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.	2,01 0,01	22,56 -0,39	2,79 -0,05	6,57 -0,15	22,56 -0,39	38,29 -0,72	55,99 -0,80
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,15 0,14	23,61 0,66	2,82 -0,02	6,73 0,00	23,61 0,66	39,29 0,29	56,74 -0,05
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,37 98,61	5,81 97,52	1,10 88,98	2,64 94,47	5,81 97,52	12,53 98,18	23,97 100,07
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,34 -0,81	11,91 7,61	1,19 -0,57	3,28 1,25	11,91 7,61	21,11 12,90	36,70 25,30
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,02	22,59 -0,36	2,70 -0,15	6,52 -0,20	22,59 -0,36	38,33 -0,68	55,69 -1,10
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,40 0,17	15,95 2,79	2,84 0,22	5,98 0,50	15,95 2,79	29,58 5,26	47,88 7,93
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,21 -0,03	12,85 -0,30	2,52 -0,10	5,31 -0,17	12,85 -0,30	23,77 -0,55	39,09 -0,86
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,02	6,49 -0,27	1,31 -0,07	3,18 -0,15	6,49 -0,27	13,69 -0,52	26,04 -0,87
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,19 -0,04	12,89 -0,27	2,54 -0,08	5,34 -0,13	12,89 -0,27	23,78 -0,53	39,16 -0,80
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,09 -0,62	12,68 1,90	2,51 -0,81	5,09 -0,01	12,68 1,90	32,95 11,55	45,32 14,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,61 -0,01	11,68 -0,35	1,81 -0,05	4,59 -0,13	11,68 -0,35	23,64 -0,41	41,94 -0,97
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,98 -0,02	22,53 -0,42	2,77 -0,08	6,55 -0,17	22,53 -0,42	38,05 -0,96	54,91 -1,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,12 -0,52	13,34 2,75	2,43 -0,85	5,23 0,09	13,34 2,75	33,37 11,81	45,31 12,75
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,96 0,05	13,07 0,44	1,81 -0,09	4,48 -0,06	13,07 0,44	24,27 0,61	39,50 -0,09
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,02	6,51 -0,25	1,32 -0,06	3,20 -0,13	6,51 -0,25	13,79 -0,41	26,36 -0,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,59 -0,56	16,43 12,13	1,80 0,03	4,97 2,94	16,43 12,13	25,53 17,32	39,61 28,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,40	6,55	1,33	3,22	6,55	13,80	26,25

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	-0,21	-0,05	-0,11	-0,21	-0,40	-0,66
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,98 -0,02	22,58 -0,37	2,78 -0,07	6,57 -0,15	22,58 -0,37	38,26 -0,75	55,67 -1,12
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	2,62 698,31	32,29 541,85	8,83 712,04	11,25 401,81	32,29 541,85	29,08 227,87	67,09 280,06
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	0,93 248,99	7,82 131,27	1,59 128,30	3,48 124,30	7,82 131,27	13,47 105,56	29,82 124,46
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	6,70 -0,15	41,91 10,33	10,08 -0,32	14,72 0,18	41,91 10,33	44,59 -6,77	69,67 -22,35
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	8,52 -1,46	42,07 -3,09	12,87 -1,42	17,37 -4,96	42,07 -3,09	57,34 -10,98	88,35 -22,54
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	7,81 0,96	32,92 1,33	11,38 0,97	16,66 2,12	32,92 1,33	52,79 1,42	108,92 16,90
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	13,14 6,29	58,00 26,42	21,00 10,59	33,01 18,47	58,00 26,42	59,01 7,64	130,45 38,43
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,03 2,18	44,31 12,72	14,71 4,31	19,14 4,61	44,31 12,72	67,00 15,64	
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,96 3,11	49,33 17,75	16,51 6,11	25,80 11,26	49,33 17,75	80,06 28,69	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,51 0,66	42,62 11,03	10,02 -0,39	17,23 2,69	42,62 11,03	73,48 22,11	110,31 18,29
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,81 1,96	41,43 9,85	13,36 2,95	16,02 1,49	41,43 9,85		
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	6,93 0,08	51,54 19,96	10,07 -0,34	11,24 -3,30	51,54 19,96		
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	-2,06 -8,91	36,95 5,37	7,99 -2,42	13,16 -1,37	36,95 5,37		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	-2,27 -3,91	2,96 0,62					
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,22 -8,07	37,35 5,77	4,42 -5,99	13,62 -0,91	37,35 5,77		
CDI	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
IBOVESPA	6,85	31,58	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
INPC + 6%	1,71	10,78	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25
IPCA + 6%	1,64	10,59	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56

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	0,42	6,76	1,38	3,33	6,76	14,21	26,90
IRF-M 1+	0,72	14,24	2,10	5,44	14,24	28,25	49,63
IRF-M TOTAL	0,62	12,03	1,86	4,72	12,03	24,05	42,91
IMA-B 5	1,24	13,15	2,62	5,47	13,15	24,32	39,95
IMA-B 5+	2,60	30,37	3,02	7,64	30,37	50,45	69,64
IMA-B TOTAL	2,01	22,95	2,85	6,72	22,95	39,01	56,79
IMA-C TOTAL	0,40	19,41	1,84	5,35	19,41	41,36	56,88
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,91	12,63	1,90	4,54	12,63	23,66	39,60
IMA-GERAL TOTAL	0,90	12,82	1,90	4,56	12,82	24,14	40,06
IDKA 2	1,20	11,82	2,46	5,25	11,82	22,73	39,44
IDKA 20	3,94	44,26	3,32	8,71	44,26	73,70	94,85
CDI	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
Renda Variável							
IBOVESPA	6,85	31,58	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
IBRX 100	7,27	33,39	10,70	15,40	33,39	53,96	96,37
IBRX 50	6,56	29,15	9,81	13,17	29,15	47,91	87,58
SMALL CAP	12,65	58,20	21,15	32,65	58,20	71,06	155,48
IFIX	10,63	35,98	19,12	21,76	35,98	43,62	71,49
Índice Consumo - ICON	8,03	55,25	9,06	27,92	55,25	40,39	86,91
Índice Dividendos - IDIV	9,99	45,16	14,28	22,33	45,16	68,32	110,90
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,15	4,31	1,77	2,03	4,31	8,21	11,40
INPC	1,22	4,48	1,81	1,98	4,48	8,07	10,30
IGPM	2,09	7,30	3,09	2,80	7,30	15,39	14,79
SELIC	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,77	23,98
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
107	02/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.000,00	5,48210600	182,4116519000
94	04/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.725.000,00	14.933,59017200	182,4745402000
101	04/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	773.000,00	0,00	4.236,20741400	182,4745402000
108	04/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	15.000,00	82,20324900	182,4745402000
91	09/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.340.000,00	0,00	23.771,58002300	182,5709522000
92	09/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	1.689.000,00	0,00	9.251,19784800	182,5709522000
103	09/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	773.000,00	4.233,97035900	182,5709522000
105	09/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	414.000,00	0,00	2.267,61155100	182,5709522000
95	10/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.689.000,00	9.249,51890500	182,6040919000
112	10/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4.170.000,00	0,00	238.477,53199000	17,4859240000
137	10/12/2019	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,00	4.164.687,02	37.300,00000000	111,6538075000
109	11/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.000,00	21,90084700	182,6413415000
116	11/12/2019	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	1.689.000,00	0,00	16.484,53456835	102,4596717000
110	12/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	11.000,00	60,21563100	182,6768203000
96	13/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.199.000,00	12.035,38034700	182,7113009000
102	13/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	325.000,00	0,00	1.778,76244400	182,7113009000
97	18/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.394.276,11	7.627,18992300	182,8033816000
98	18/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.688.693,09	9.237,75630000	182,8033816000
99	18/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	456.723,89	2.498,44337600	182,8033816000
100	18/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	306,91	1,67894300	182,8033816000
111	18/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	45.000,00	246,16612500	182,8033816000
113	18/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	4.170.000,00	238.246,79157000	17,5028590000
115	19/12/2019	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1.689.000,00	0,00	1.146.040,27296200	1,4737701980
138	19/12/2019	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	4.166.783,90	0,00	36.400,00000000	114,4720852000
104	23/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	325.000,00	1.776,94742100	182,8979272000
93	26/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	3.724.000,00	0,00	20.354,97534600	182,9528131000
106	26/12/2019	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	386.000,00	0,00	2.109,83364300	182,9528131000
90	27/12/2019	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	1.832.000,00	0,00	643.092,12171780	2,8487365000

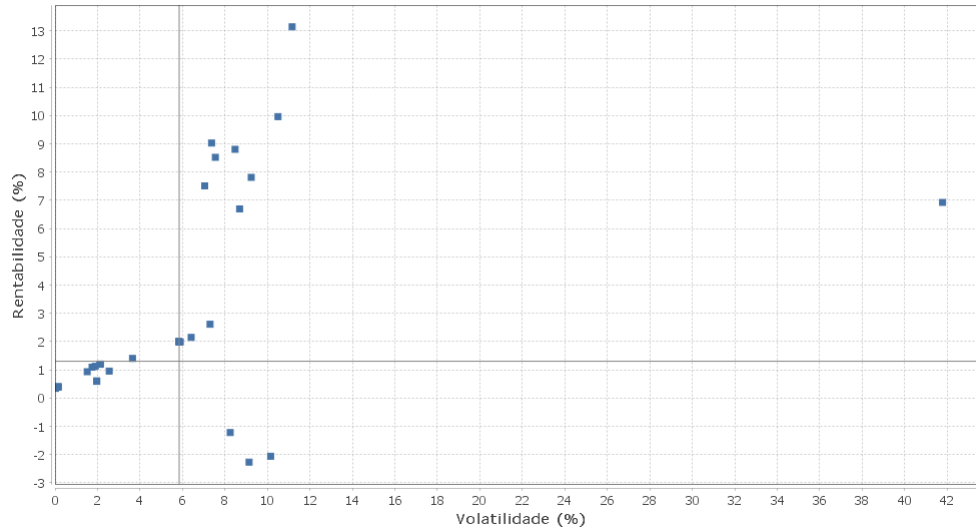
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
114	27/12/2019	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	1.833.000,00	0,00	4.458,41179540	411,1329514000

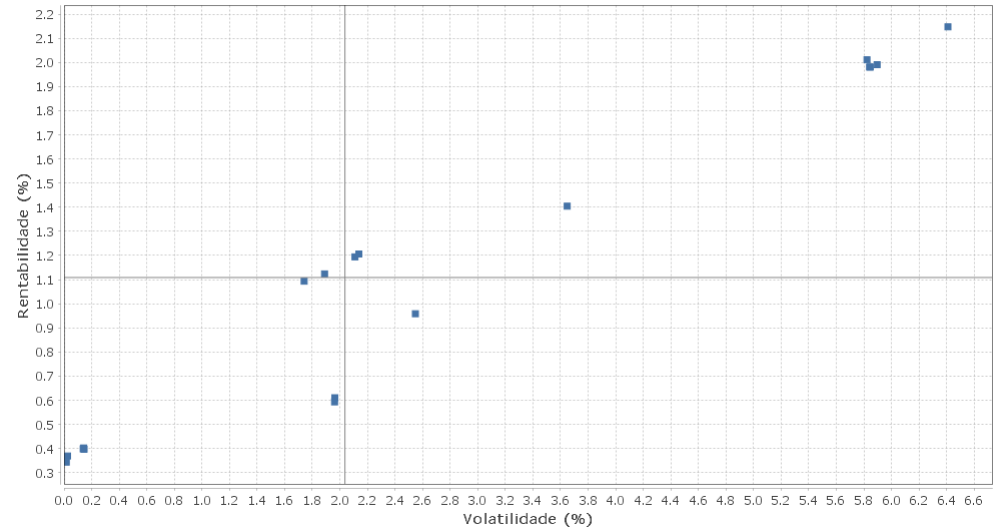
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

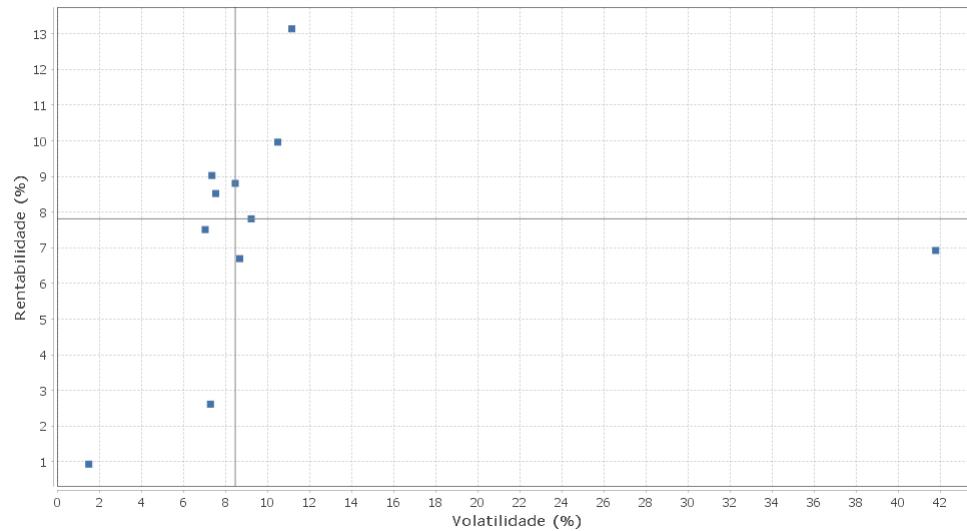
MOGI DAS CRUZES - No Mês



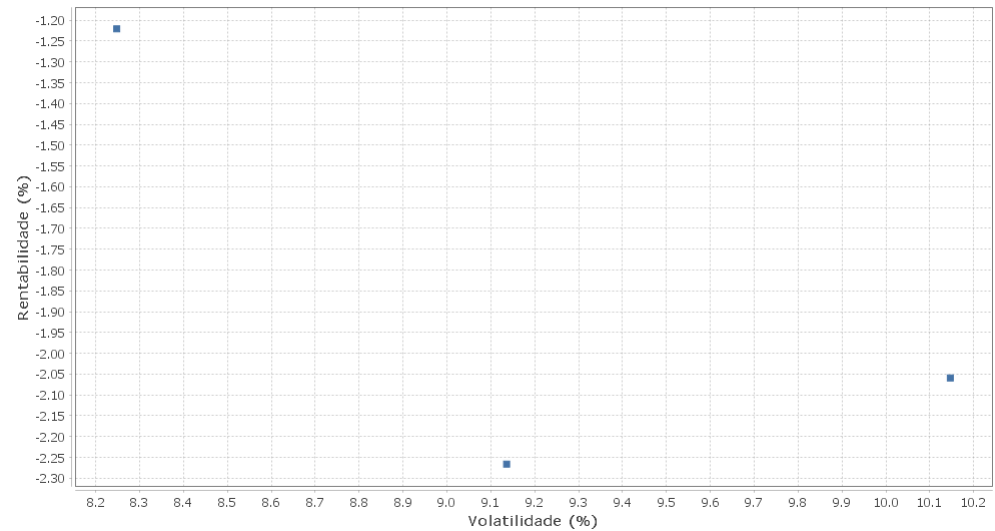
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,28	0,01	-1,93	0,34	22.842.294,97	3,61
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	-0,20	0,37	6.771.355,13	1,07
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,12	0,00	0,17	0,40	14.899,19	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,12	0,00	0,20	0,40	76.436,93	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,12	0,00	0,16	0,40	59.694,47	0,01
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	1,51	0,82	0,00	0,37	0,93	3.319.552,40	0,52
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	0,76	0,00	0,41	1,09	4.451.305,93	0,70
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,89	0,85	0,02	0,40	1,12	15.983.483,66	2,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	1,41	0,12	0,11	0,59	63.230.602,44	9,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,95	0,13	0,12	0,61	103.048.685,16	16,27
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	0,86	0,01	0,39	1,19	12.626.808,58	1,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	0,86	0,12	0,39	1,21	107.863.207,32	17,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	1,08	0,08	0,23	0,96	54.489.211,68	8,60
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,43	0,00	0,28	1,40	2.339.530,69	0,37
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,82	2,28	0,00	0,28	2,01	1.565.554,38	0,25
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,84	2,29	0,04	0,27	1,98	13.960.159,26	2,20
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	2,29	0,06	0,27	1,98	19.975.314,96	3,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,90	2,33	0,33	0,27	1,99	108.484.183,39	17,13
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,41	2,55	0,02	0,28	2,15	5.812.632,09	0,92
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	7,05	7,04	0,01	1,01	7,51	923.826,46	0,15
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	7,30	6,71	0,06	0,31	2,62	11.730.755,26	1,85
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	7,37	7,40	0,03	1,17	9,03	2.852.264,80	0,45
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	7,55	8,41	0,11	1,08	8,52	11.663.690,86	1,84
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	8,25	6,88	0,00	-0,19	-1,22	2.026.936,09	0,32
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,48	7,29	0,01	0,99	8,81	1.718.752,21	0,27
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	8,69	7,20	0,15	0,73	6,70	17.297.053,16	2,73
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	9,14	5,53	-0,00	-0,29	-2,27	1.697.207,40	0,27
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	9,24	7,42	0,04	0,81	7,81	5.013.352,20	0,79
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	10,15	8,13	-0,00	-0,24	-2,06	844.073,83	0,13
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	10,50	8,79	0,22	0,91	9,96	20.262.491,41	3,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	11,16	8,96	0,06	1,14	13,14	6.249.581,50	0,99
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	41,78	16,36	-0,01	0,16	6,93	4.229.696,49	0,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês, dezembro de 2019, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 7, Inciso IV, Alínea A (5,84% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.