



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FERREIRA**  
NOVEMBRO 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 19.12.2019.

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

79,21%

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-M                                   | 2,12                | -0,47           | 11,12           | 4.469.928,54         | 2,64         | 5.340.318.585,55  | 0,08    |
| BB                                     | BB        | BB PREV IMAB TPB                                   | 4,72                | -2,48           | 20,27           | 4.746.288,36         | 2,80         | 6.381.244.003,26  | 0,07    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO            | 4,72                | -2,54           | 20,20           | 11.198.593,18        | 6,61         | 6.860.700.810,84  | 0,16    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF                      | 0,24                | 0,31            | 6,12            | 6.289.870,22         | 3,71         | 10.884.142.147,81 | 0,06    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO           | 1,93                | -0,34           | 11,51           | 11.183.020,41        | 6,60         | 9.996.525.968,83  | 0,11    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IDKA2                                   | 1,46                | 0,21            | 9,94            | 7.295.948,51         | 4,31         | 7.846.560.538,65  | 0,09    |
| BB                                     | BB        | BB PREV IMA-B5+                                    | 7,01                | -4,10           | 26,61           | 3.963.186,27         | 2,34         | 2.996.336.299,76  | 0,13    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI | 1,92                | -0,30           | 11,54           | 1.452.279,64         | 0,86         | 1.298.833.749,12  | 0,11    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP                   | 6,98                | -4,16           | 26,50           | 7.375.306,59         | 4,35         | 3.038.651.285,90  | 0,24    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP              | 1,46                | 0,01            | 9,98            | 7.310.595,31         | 4,32         | 8.616.453.115,07  | 0,08    |
| BB                                     | BB        | BB PREV ALOC FIC                                   | 2,29                | -0,94           | 4,83            | 3.669.202,40         | 2,17         | 9.385.285.182,14  | 0,04    |
| CEF                                    | CEF       | FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF                   | 3,74                | -0,51           | 6,22            | 3.717.630,86         | 2,19         | 9.094.359.000,50  | 0,04    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |           |  | <b>3,01</b>         | <b>-1,34</b>    | <b>14,93</b>    | <b>72.671.850,29</b> | <b>42,90</b> |                   |         |

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 | 4,68                | -2,53           | 20,07           | 13.348.432,38        | 7,88        | 3.032.568.083,13 | 0,44    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |                            | <b>4,68</b>         | <b>-2,53</b>    | <b>20,07</b>    | <b>13.348.432,38</b> | <b>7,88</b> |                  |         |

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 |
|--------|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------|------------------|---------|
| CEF    | CEF    | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP        | 0,07                | 0,33            | 5,52            | 24.702.849,91 | 14,58      | 3.622.914.055,68 | 0,68    |
| CEF    | CEF    | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,05                | 0,31            | 5,34            | 8.563.137,14  | 5,06       | 4.576.303.484,03 | 0,19    |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

|   |      |                                      |             |             |             |                      |              |                  |      |
|---|------|--------------------------------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|------------------|------|
| BB                                      | BB   | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,04        | 0,34        | 5,37        | 5.061,80             | 0,00         | 2.711.296.282,19 | 0,00 |
| GRAPHEN                                 | ORLA | LME REC IMA-B FI RENDA FIXA          | 3,70        | -1,21       | 11,12       | 4.678.254,87         | 2,76         | 72.125.088,41    | 6,49 |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |      |                                      | <b>0,54</b> | <b>0,13</b> | <b>6,59</b> | <b>37.949.303,72</b> | <b>22,40</b> |                  |      |

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

| Gestor                                   | Admin. | Ativo                                   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo   | % Fundo |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|---------------|---------|
| RJI                                      | RJI    | INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B | 387,93              | -100,00         | -98,94          | 0,00                | 0,00        | 861.375,60    | 0,00    |
| GRAPHEN                                  | ORLA   | LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC           | 1,64                | -0,18           | 1,24            | 1.288.633,47        | 0,76        | 76.608.869,19 | 1,68    |
| RJI                                      | RJI    | INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II        | 4,90                | -0,18           | 2,18            | 2.012.817,60        | 1,19        | 56.994.804,20 | 3,53    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b> |        |   | <b>2,82</b>         | <b>-0,19</b>    | <b>-0,13</b>    | <b>3.301.451,07</b> | <b>1,95</b> |               |         |

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 |
|--|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| BRPP                                     | INTRADER | PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | 32,48               | 33,24           | 33,26           | 6.896.805,72          | 4,07         | 153.968.435,74 | 4,48    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> |          |  | <b>32,48</b>        | <b>33,24</b>    | <b>33,26</b>    | <b>6.896.805,72</b>   | <b>4,07</b>  |                |         |
| <b>Renda Fixa</b>                        |          |  | <b>2,51</b>         | <b>0,32</b>     | <b>13,12</b>    | <b>134.167.843,18</b> | <b>79,21</b> |                |         |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**20,79%**

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 |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| BB                                     | BB     | BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO | 17,77               | 0,99            | 24,49           | 3.837.712,26        | 2,27        | 636.603.614,74 | 0,60    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b> |        |   | <b>17,77</b>        | <b>0,99</b>     | <b>24,49</b>    | <b>3.837.712,26</b> | <b>2,27</b> |                |         |

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  | 17,39               | 1,38            | 23,29           | 2.954.744,85         | 1,74         | 728.046.066,33   | 0,41    |
| BRADESCO                                | BEM       | BRADESCO F I A SELECTION            | 18,36               | -1,45           | 19,01           | 4.593.836,36         | 2,71         | 901.862.736,04   | 0,51    |
| BRADESCO                                | BRADESCO  | BRADESCO FIA DIVIDENDOS             | 17,37               | -0,05           | 15,27           | 3.780.605,59         | 2,23         | 2.801.644.378,47 | 0,13    |
| BRADESCO                                | BEM       | BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 15,65               | 2,99            | 30,83           | 1.370.056,86         | 0,81         | 1.395.974.287,42 | 0,10    |
| XP                                      | XP        | XP INVESTOR FIA                     | 17,53               | 3,68            | 37,10           | 7.231.537,06         | 4,27         | 430.371.003,87   | 1,68    |
| BB                                      | BB        | BB PREVID ALOC                      | 17,50               | 0,83            | 21,96           | 4.814.671,69         | 2,84         | 390.393.482,06   | 1,23    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |           |                                     | <b>17,07</b>        | <b>1,26</b>     | <b>24,94</b>    | <b>24.745.452,41</b> | <b>14,61</b> |                  |         |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor                         | Admin. | Ativo                                      | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)      | % Carteira  | PL do Fundo  | % Fundo |
|--------------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|------------------|-------------|--------------|---------|
| GRAPHEN                        | ORLA   | LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | 1,77                | -0,86           | -0,11           | 19.212,49        | 0,01        | 1.584.664,65 | 1,21    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b> |        |  | <b>1,77</b>         | <b>-0,86</b>    | <b>-0,11</b>    | <b>19.212,49</b> | <b>0,01</b> |              |         |

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 |
|---|------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| BRPP                                    | BNY MELLON | GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA | 1,03                | -0,03           | 1,03            | 4.366.529,37        | 2,58        | 267.517.064,75 | 1,63    |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b> |            |  | <b>1,03</b>         | <b>-0,03</b>    | <b>1,03</b>     | <b>4.366.529,37</b> | <b>2,58</b> |                |         |

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------|--------|-------|---------------------|-----------------|-----------------|-------------|------------|-------------|---------|
|--------|--------|-------|---------------------|-----------------|-----------------|-------------|------------|-------------|---------|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

|     |     |   |             |              |             |                       |               |               |      |
|-----|-----|---|-------------|--------------|-------------|-----------------------|---------------|---------------|------|
| RJI | RJI | HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO       | 2,24        | -0,01        | 1,11        | 2.245.453,94          | 1,33          | 70.358.482,41 | 3,19 |
|     |     | <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>     | <b>2,24</b> | <b>-0,01</b> | <b>1,11</b> | <b>2.245.453,94</b>   | <b>1,33</b>   |               |      |
|     |     | Renda Variável e Investimentos Estruturados | 13,58       | 0,98         | 19,57       | 35.214.360,47         | 20,79         |               |      |
|     |     | <b>Total</b>                                |             |              |             | <b>169.382.203,65</b> | <b>100,00</b> |               |      |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo   | Tipo de Ativo  | Valor(R\$)            | % Carteira   | Política de Investimentos |          |        |              |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
|  |  |                       |              | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>                                  |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 7º I, Alínea b                              | Fundos 100% Títulos Públicos                             | 72.671.850,29         | 42,90        | 0,00                      | 33,00    | 70,00  | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                            | Fundos Renda Fixa Referenciados                          | 13.348.432,38         | 7,88         | 0,00                      | 15,00    | 60,00  | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                             | Fundos de Renda Fixa                                     | 37.949.303,72         | 22,40        | 0,00                      | 15,00    | 40,00  | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea a                            | Cota Sênior de FIDC                                      | 3.301.451,07          | 1,95         | 0,00                      | 2,00     | 5,00   | 5,00         |
| Artigo 7º VII, Alínea b                            | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"                      | 6.896.805,72          | 4,07         | 0,00                      | 5,00     | 7,00   | 5,00         |
|  | <b>Total Renda Fixa</b>                                  | <b>134.167.843,18</b> | <b>79,21</b> |                           |          |        |              |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 8º I, Alínea a                              | Fundos de Ações Referenciados                            | 3.837.712,26          | 2,27         | 0,00                      | 3,00     | 5,00   | 30,00        |
| Artigo 8º II, Alínea a                             | Fundos de Ações  | 24.745.452,41         | 14,61        | 0,00                      | 15,00    | 15,00  | 20,00        |
| Artigo 8º III                                      | Fundos Multimercados                                     | 19.212,49             | 0,01         | 0,00                      | 4,00     | 10,00  | 10,00        |
| Artigo 8º IV, Alínea a                             | Fundos de Participações                                  | 4.366.529,37          | 2,58         | 0,00                      | 5,00     | 5,00   | 5,00         |
| Artigo 8º IV, Alínea b                             | Fundos de Investimentos Imobiliários                     | 2.245.453,94          | 1,33         | 0,00                      | 3,00     | 3,00   | 5,00         |
|  | <b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> | <b>35.214.360,47</b>  | <b>20,79</b> |                           |          |        |              |

**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<br>% do CDI            | -1,34<br>-351,34  | 14,93<br>268,35 | 3,09<br>232,60    | 6,72<br>232,02    | 16,52<br>271,45 | -984.375,31  | 8.883.752,78  |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | -2,53<br>-665,13  | 20,07<br>360,75 | 3,60<br>270,68    | 8,30<br>286,63    | 22,03<br>361,98 | -346.487,07  | 2.231.528,10  |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 0,13<br>34,24     | 6,59<br>118,44  | 1,35<br>101,58    | 3,09<br>106,67    | 7,35<br>120,77  | 49.122,18    | 2.419.702,11  |
| Artigo 7º VII, Alínea a<br>% do CDI          | -0,19<br>-48,77   | -0,13<br>-2,32  | -0,35<br>-26,62   | -0,45<br>-15,39   | -0,12<br>-1,98  | -6.136,43    | -4.264,26     |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 33,24<br>8.739,50 | 33,26<br>597,65 | 34,92<br>2.626,96 | 34,26<br>1.182,92 | 32,99<br>542,19 | 1.720.716,71 | 1.721.166,83  |
| Artigo 8º I, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p.  | 0,99<br>0,05      | 24,49<br>1,34   | 6,97<br>-0,05     | 12,80<br>1,25     | 23,42<br>2,49   | 37.714,63    | 755.063,93    |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 1,26<br>0,31      | 24,94<br>1,79   | 5,69<br>-1,33     | 13,76<br>2,22     | 25,39<br>4,47   | 306.803,20   | 4.939.084,42  |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | -0,86<br>-1,81    | -0,11<br>-23,26 | -2,61<br>-9,62    | -3,83<br>-15,37   | 1,44<br>-19,49  | -167,63      | -21,47        |
| Artigo 8º IV, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -0,03<br>-0,97    | 1,03<br>-22,12  | -0,09<br>-7,11    | 0,21<br>-11,33    | 0,99<br>-19,93  | -1.160,58    | 44.329,20     |
| Artigo 8º IV, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | -0,01<br>-0,95    | 1,11<br>-22,04  | -0,02<br>-7,04    | 0,03<br>-11,52    | 1,18<br>-19,75  | -141,01      | 24.724,20     |
|  |                   |                 |                   |                   |                 | 775.888,69   | 21.015.065,84 |

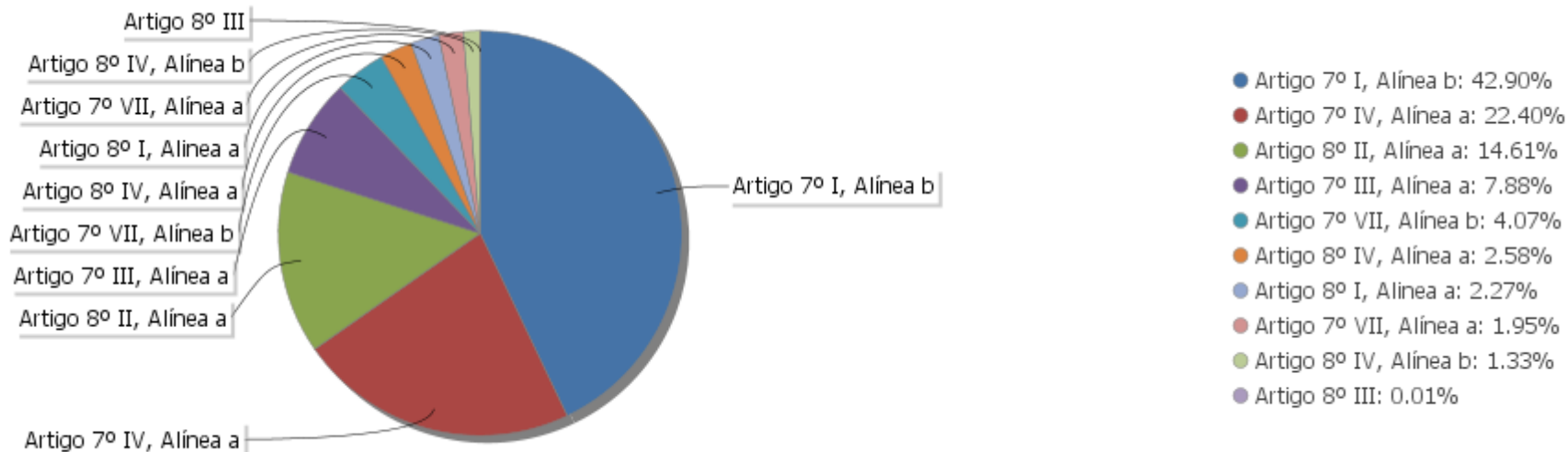
**Análise de Liquidez**

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 156.518.509,59 | 92,41 | 156.518.509,59        | 92,41     |
| de 31 a 364 dias  | 0,00           | 0,00  | 156.518.509,59        | 92,41     |
| acima de 365 dias | 12.863.694,06  | 7,59  | 169.382.203,65        | 100,00    |

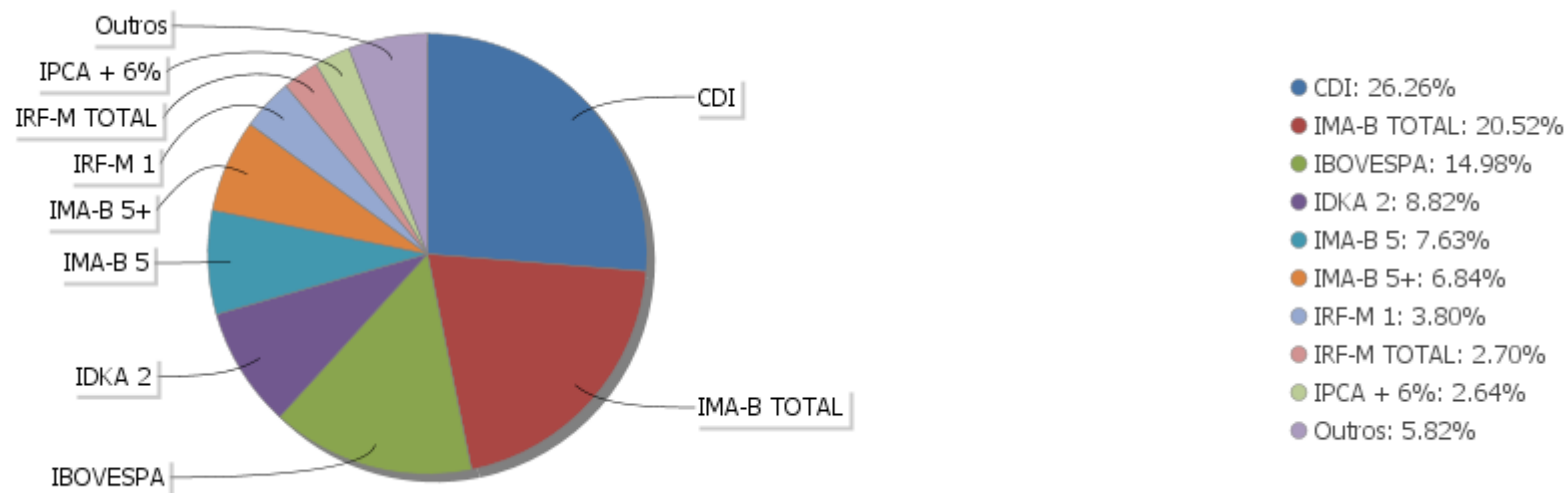


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

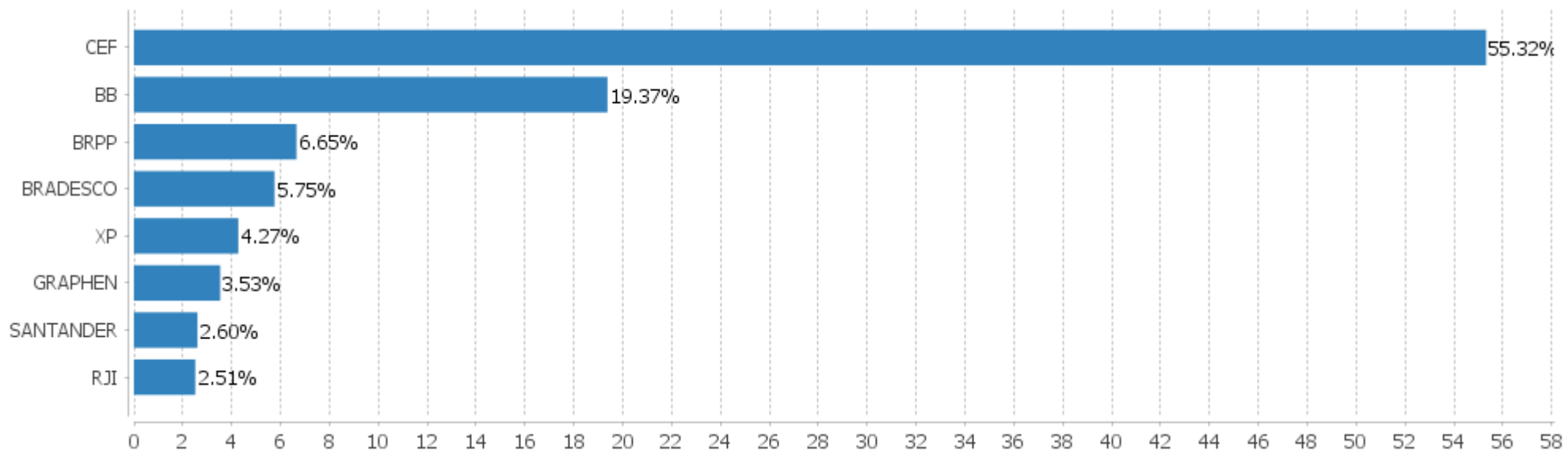


Alocação Por Estratégia



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           | 3,17 | 0,13  | 0,33  | 0,93  | 1,68  | 2,27  | 1,00 | 0,16  | 1,69  | 1,80 | 0,46  |      | 14,45    |
| IPCA + 6%      | 0,83 | 0,90  | 1,19  | 1,06  | 0,64  | 0,45  | 0,72 | 0,62  | 0,45  | 0,63 | 0,98  |      | 8,80     |
| p.p. indexador | 2,34 | -0,76 | -0,87 | -0,13 | 1,04  | 1,82  | 0,27 | -0,46 | 1,25  | 1,17 | -0,52 |      | 5,64     |
| 2018           | 2,72 | -0,87 | 0,78  | 0,37  | -2,04 | -0,27 | 2,02 | -0,90 | 0,55  | 4,00 | 0,72  | 0,93 | 8,16     |
| 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 | 1,92 | -1,61 | 0,20  | -0,34 | -2,93 | -2,02 | 1,18 | -1,34 | -0,37 | 3,04 | 0,46  | 0,31 | -1,76    |

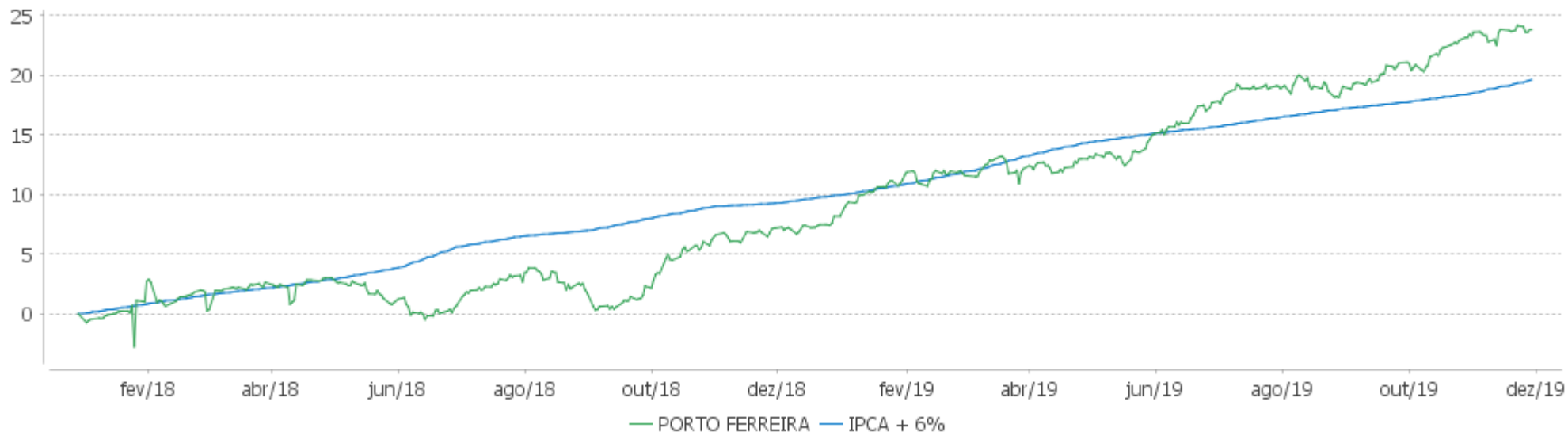
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

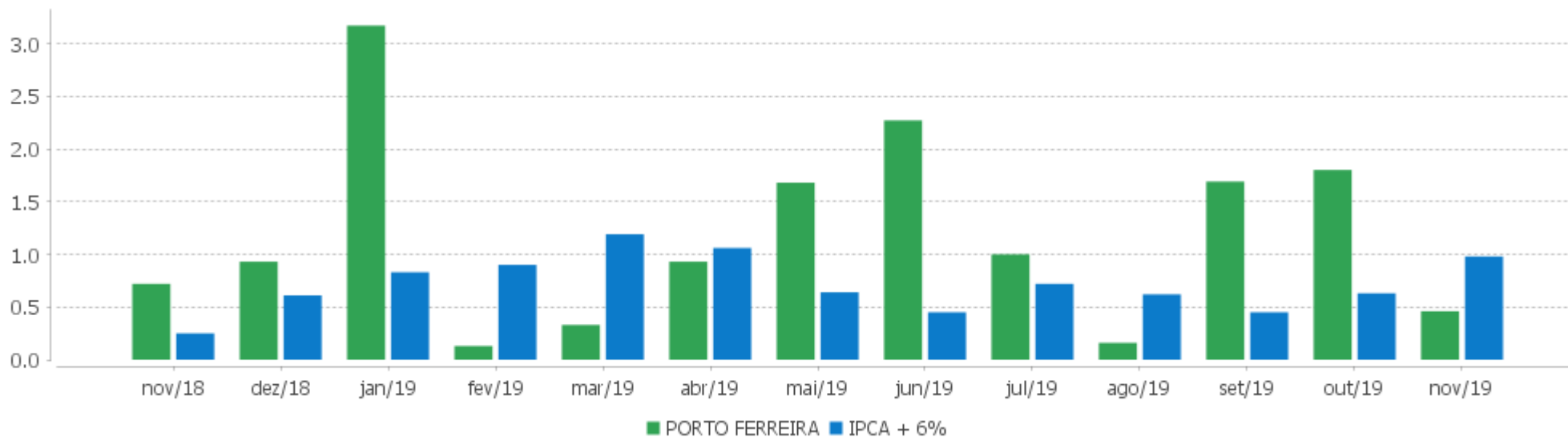
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | IPCA + 6% | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|-----------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 12         | 52,17     | 03 meses         | 4,00     | 2,07      | 1,93       | 3,81               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 11         | 47,83     | 06 meses         | 7,59     | 3,91      | 3,68       | 4,00               |
|                                 |            |           | 12 meses         | 15,51    | 9,47      | 6,04       | 4,11               |
|                                 |            |           | 24 meses         |          |           |            |                    |
|                                 |            |           | 36 meses         |          |           |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,00       | 2018-10   |                  |          |           |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -2,04      | 2018-05   | Desde 29/12/2017 | 23,78    | 19,60     | 4,19       | 6,30               |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia   | No Mês              | No Ano              | 3 meses             | 6 meses             | 12 meses            | 24 meses        | 36 meses          |
|---|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------|-------------------|
| INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II<br>% do CDI                            | -0,18<br>-47,57     | 2,18<br>39,22       | 0,46<br>34,40       | 0,40<br>13,67       | 2,18<br>35,86       | 45,35<br>350,30 |                   |
| INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B<br>% do CDI                     | 290,17<br>76.283,98 | -98,94<br>-1.778,16 | -81,26<br>-6.113,02 | -96,30<br>-3.325,17 | -98,94<br>-1.625,92 |                 |                   |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC<br>% do CDI                               | -0,18<br>-47,18     | 1,24<br>22,29       | -1,33<br>-99,83     | -0,37<br>-12,60     | 1,26<br>20,76       |                 |                   |
| PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO<br>% do CDI          | 33,24<br>8.739,50   | 33,26<br>597,65     | 34,92<br>2.626,96   | 34,26<br>1.182,92   | 32,99<br>542,19     | -2,15<br>-16,61 | -28,69<br>-115,34 |
| FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                     | -2,53<br>-0,08      | 20,07<br>-0,46      | 3,60<br>-0,11       | 8,30<br>-0,23       | 22,03<br>-0,49      | 36,72<br>-0,68  | 56,64<br>-1,54    |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                        | 0,34<br>89,83       | 5,37<br>96,49       | 1,24<br>92,92       | 2,76<br>95,33       | 5,86<br>96,33       | 12,70<br>98,07  | 24,74<br>99,42    |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP<br>% do CDI                      | 0,33<br>86,04       | 5,52<br>99,15       | 1,32<br>99,00       | 2,87<br>99,26       | 6,03<br>99,04       | 12,65<br>97,67  | 24,50<br>98,49    |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI               | 0,31<br>81,03       | 5,34<br>96,05       | 1,21<br>90,92       | 2,73<br>94,22       | 5,85<br>96,15       | 12,49<br>96,50  | 24,39<br>98,05    |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                    | -1,21<br>1,25       | 11,12<br>-9,42      | 1,76<br>-1,95       | 4,13<br>-4,40       | 12,63<br>-9,89      |                 |                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.        | -2,54<br>-0,09      | 20,20<br>-0,34      | 3,57<br>-0,14       | 8,30<br>-0,23       | 22,16<br>-0,37      | 36,72<br>-0,68  | 57,04<br>-1,14    |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO<br>Var. IMA-B 5 p.p.           | -0,34<br>-0,05      | 11,51<br>-0,26      | 3,04<br>-0,09       | 5,82<br>-0,15       | 13,05<br>-0,25      | 23,35<br>-0,53  | 39,33<br>-0,85    |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI<br>Var. IMA-B 5 p.p. | -0,30<br>-0,02      | 11,54<br>-0,23      | 3,07<br>-0,06       | 5,86<br>-0,12       | 13,04<br>-0,26      | 23,36<br>-0,52  | 39,34<br>-0,83    |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.                                    | 0,21<br>0,19        | 9,94<br>-0,56       | 2,88<br>0,02        | 5,10<br>-0,18       | 11,28<br>-0,60      | 21,11<br>-1,57  | 36,65<br>-2,90    |
| BB PREV ALOC FIC<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.                      | -0,94<br>-0,24      | 12,00<br>0,39       | 2,36<br>-0,09       | 5,73<br>0,12        | 13,31<br>0,38       | 24,20<br>0,56   | 40,84<br>-0,17    |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF<br>Var. IPCA p.p.                      | -0,51<br>-1,02      | 15,75<br>12,63      | 3,34<br>2,77        | 7,20<br>6,32        | 17,28<br>14,01      | 25,78<br>18,33  | 40,59<br>30,13    |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p.               | 0,01<br>-0,00       | 9,98<br>-0,51       | 2,73<br>-0,13       | 5,04<br>-0,24       | 11,25<br>-0,63      | 21,26<br>-1,42  | 36,70<br>-2,84    |
| BB PREV RF IRF-M<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.                               | -0,47<br>-0,01      | 11,12<br>-0,22      | 2,64<br>-0,05       | 6,21<br>-0,11       | 12,80<br>-0,25      | 24,32<br>-0,50  | 43,68<br>-0,96    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

|   |                  |                 |                  |                  |                 |                   |                   |
|---|------------------|-----------------|------------------|------------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.              | 0,31<br>-0,02    | 6,12<br>-0,19   | 1,56<br>-0,05    | 3,39<br>-0,10    | 6,70<br>-0,21   | 13,99<br>-0,38    | 27,22<br>-0,66    |
| BB PREV IMAB TPB<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                       | -2,48<br>-0,03   | 20,27<br>-0,27  | 3,66<br>-0,05    | 8,43<br>-0,10    | 22,21<br>-0,31  | 36,71<br>-0,69    | 57,00<br>-1,17    |
| FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.          | -4,16<br>-0,09   | 26,50<br>-0,56  | 3,99<br>-0,16    | 9,97<br>-0,24    | 28,78<br>-0,67  | 46,54<br>-1,24    | 69,60<br>-1,87    |
| BB PREV IMA-B5+<br>Var. IMA-B 5+ p.p.                           | -4,10<br>-0,03   | 26,61<br>-0,45  | 4,09<br>-0,06    | 10,09<br>-0,12   | 28,94<br>-0,51  | 46,86<br>-0,93    | 69,57<br>-1,90    |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V<br>% do CDI          | -0,86<br>-227,25 | -0,11<br>-2,00  | -2,60<br>-195,97 | -3,83<br>-132,14 | 1,44<br>23,68   | -94,72<br>-731,57 | -94,06<br>-378,06 |
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO<br>Var. IFIX p.p.         | -0,01<br>-3,53   | 1,11<br>-21,79  | -0,02<br>-8,81   | 0,03<br>-13,20   | 1,18<br>-24,46  | -19,80<br>-50,40  | -20,38<br>-77,71  |
| BRADESCO FIA DIVIDENDOS<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.   | -0,05<br>-2,40   | 15,27<br>-16,72 | 4,26<br>-1,61    | 6,58<br>-8,11    | 15,56<br>-17,28 | 47,73<br>-12,87   | 80,69<br>-9,36    |
| BB PREVID ALOC<br>Var. IBOVESPA p.p.                            | 0,83<br>-0,11    | 21,96<br>-1,19  | 6,39<br>-0,63    | 11,26<br>-0,29   | 19,68<br>-1,25  | 49,30<br>-1,09    | 68,13<br>-6,71    |
| BRADESCO F I A SELECTION<br>Var. IBOVESPA p.p.                  | -1,45<br>-2,39   | 19,01<br>-4,15  | 2,32<br>-4,70    | 10,90<br>-0,65   | 19,36<br>-1,57  | 58,74<br>8,36     | 95,29<br>20,45    |
| XP INVESTOR FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                           | 3,68<br>2,73     | 37,10<br>13,95  | 8,12<br>1,10     | 21,54<br>9,99    | 38,78<br>17,85  | 76,88<br>26,50    | 111,43<br>36,60   |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.        | 1,38<br>0,43     | 23,29<br>0,14   | 5,44<br>-1,58    | 12,02<br>0,47    | 23,79<br>2,87   | 49,53<br>-0,86    | 91,43<br>16,59    |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS<br>Var. IBOVESPA p.p.       | 2,99<br>2,05     | 30,83<br>7,68   | 6,94<br>-0,08    | 19,49<br>7,95    | 37,17<br>16,24  | 74,43<br>24,04    | 127,03<br>52,19   |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA<br>Var. IPCA + 6% p.p.    | -0,03<br>-1,00   | 1,03<br>-7,78   | -0,09<br>-2,16   | 0,21<br>-3,70    | 0,99<br>-8,48   | -20,38<br>-41,06  | -21,60<br>-53,08  |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO<br>Var. IBOVESPA p.p. | 0,99<br>0,05     | 24,49<br>1,34   | 6,97<br>-0,05    | 12,80<br>1,25    | 23,42<br>2,49   | 49,69<br>-0,69    | 79,63<br>4,80     |
| CDI   | 0,38             | 5,56            | 1,33             | 2,90             | 6,09            | 12,95             | 24,88             |
| IBOVESPA  | 0,95             | 23,15           | 7,02             | 11,55            | 20,93           | 50,38             | 74,83             |
| INPC + 6%   | 1,01             | 8,91            | 2,03             | 3,79             | 9,57            | 20,22             | 29,88             |
| IPCA + 6%   | 0,98             | 8,80            | 2,07             | 3,91             | 9,47            | 20,68             | 31,48             |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

| Indexador                     | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| <b>Renda Fixa</b>             |        |        |         |         |          |          |          |
| IRF-M 1                       | 0,33   | 6,31   | 1,61    | 3,49    | 6,91     | 14,37    | 27,89    |
| IRF-M 1+                      | -0,83  | 13,42  | 3,27    | 7,53    | 15,61    | 29,19    | 51,70    |
| IRF-M TOTAL                   | -0,46  | 11,34  | 2,69    | 6,32    | 13,05    | 24,82    | 44,64    |
| IMA-B 5                       | -0,28  | 11,77  | 3,13    | 5,97    | 13,30    | 23,89    | 40,17    |
| IMA-B 5+                      | -4,07  | 27,06  | 4,15    | 10,21   | 29,45    | 47,79    | 71,47    |
| IMA-B TOTAL                   | -2,45  | 20,53  | 3,71    | 8,53    | 22,52    | 37,40    | 58,18    |
| IMA-C TOTAL                   | -1,15  | 18,93  | 3,20    | 8,96    | 19,85    | 41,50    | 57,00    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | -0,70  | 11,61  | 2,45    | 5,61    | 12,93    | 23,64    | 41,02    |
| IMA-GERAL TOTAL               | -0,71  | 11,82  | 2,47    | 5,71    | 13,13    | 24,13    | 41,42    |
| IDKA 2                        | 0,01   | 10,49  | 2,86    | 5,28    | 11,88    | 22,68    | 39,55    |
| IDKA 20                       | -6,02  | 38,79  | 4,15    | 11,72   | 41,69    | 68,38    | 100,86   |
| CDI                           | 0,38   | 5,56   | 1,33    | 2,90    | 6,09     | 12,95    | 24,88    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | 0,95   | 23,15  | 7,02    | 11,55   | 20,93    | 50,38    | 74,83    |
| IBRX 100                      | 0,97   | 24,34  | 6,51    | 11,98   | 22,74    | 52,63    | 78,38    |
| IBRX 50                       | 0,85   | 21,20  | 6,85    | 10,57   | 18,64    | 47,41    | 71,10    |
| SMALL CAP                     | 5,14   | 40,43  | 9,78    | 25,98   | 43,38    | 62,52    | 125,57   |
| IFIX                          | 3,52   | 22,91  | 8,79    | 13,22   | 25,64    | 30,60    | 57,32    |
| Índice Consumo - ICON         | 2,99   | 43,71  | 3,63    | 23,17   | 43,50    | 38,80    | 70,19    |
| Índice Dividendos - IDIV      | 2,35   | 31,98  | 5,87    | 14,68   | 32,84    | 60,60    | 90,05    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,51   | 3,12   | 0,57    | 0,88    | 3,27     | 7,45     | 10,47    |
| INPC                          | 0,54   | 3,22   | 0,53    | 0,76    | 3,37     | 7,04     | 9,13     |
| IGPM                          | 0,30   | 5,12   | 0,97    | 1,50    | 3,99     | 14,07    | 13,06    |
| SELIC                         | 0,38   | 5,56   | 1,33    | 2,89    | 6,08     | 12,95    | 24,90    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA + 4%                     | 0,82   | 6,91   | 1,58    | 2,91    | 7,41     | 16,19    | 24,20    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

|              |      |      |      |      |      |       |       |
|--------------|------|------|------|------|------|-------|-------|
| IPCA + 5%    | 0,90 | 7,86 | 1,82 | 3,41 | 8,44 | 18,42 | 27,80 |
| IPCA + 5,5%  | 0,94 | 8,33 | 1,95 | 3,66 | 8,95 | 19,55 | 29,63 |
| IPCA + 5,89% | 0,97 | 8,70 | 2,04 | 3,86 | 9,36 | 20,43 | 31,07 |
| IPCA + 6%    | 0,98 | 8,80 | 2,07 | 3,91 | 9,47 | 20,68 | 31,48 |
| INPC + 4%    | 0,85 | 7,02 | 1,54 | 2,79 | 7,50 | 15,74 | 22,69 |
| INPC + 6%    | 1,01 | 8,91 | 2,03 | 3,79 | 9,57 | 20,22 | 29,88 |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

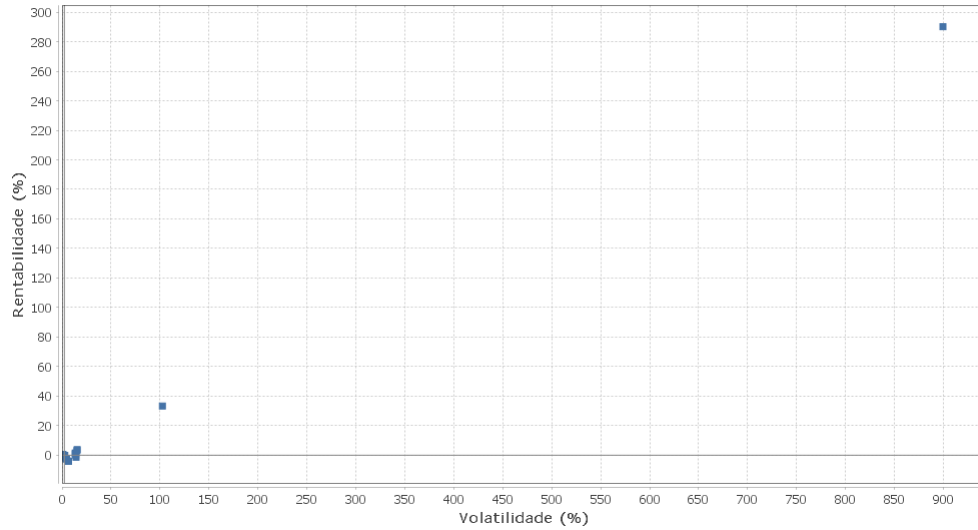
## Movimentações

| Data       | Ativo                                  | Aplicação  | Resgate | Quantidade       | Valor Cota   |
|------------|--|------------|---------|------------------|--------------|
| 06/11/2019 | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 13.000,00  | 0,00    | 3.309,74587771   | 3,9277940000 |
| 07/11/2019 | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 393.242,40 | 0,00    | 100.104,34472708 | 3,9283250000 |
| 18/11/2019 | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 3.515,86   | 0,00    | 894,20425242     | 3,9318310000 |
| 21/11/2019 | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 88.300,00  | 0,00    | 22.447,20267943  | 3,9336750000 |
| 28/11/2019 | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 30.000,00  | 0,00    | 7.619,21983760   | 3,9374110000 |
| 29/11/2019 | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 7.000,00   | 0,00    | 1.777,50737094   | 3,9380990000 |

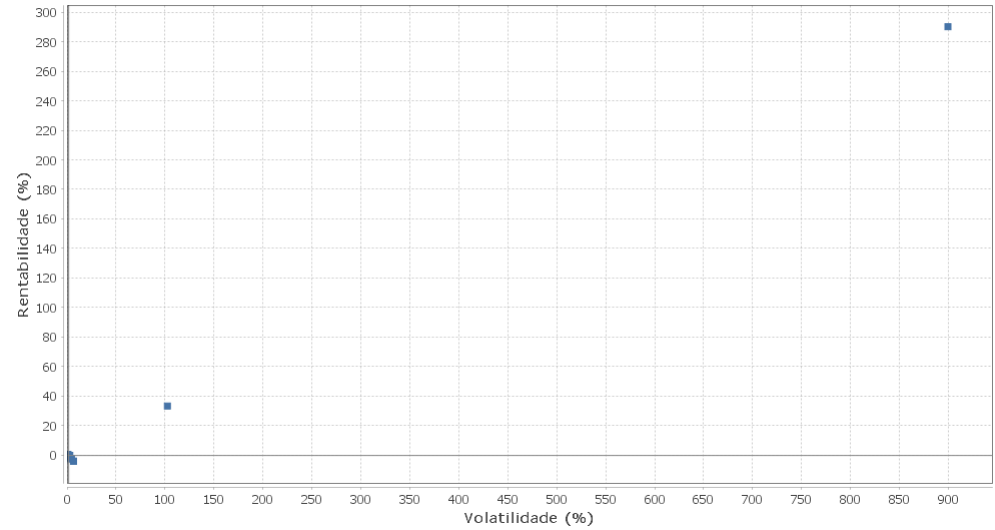
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

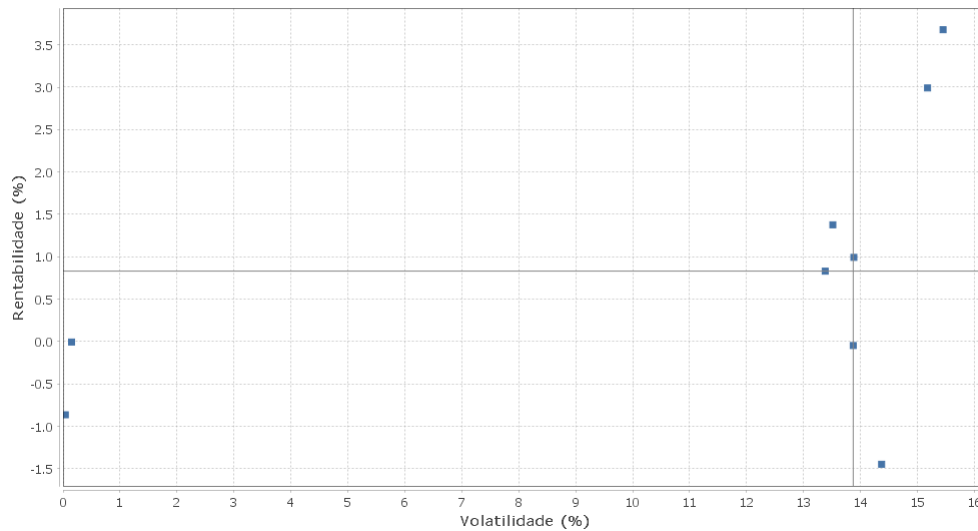
PORTO FERREIRA - No Mês



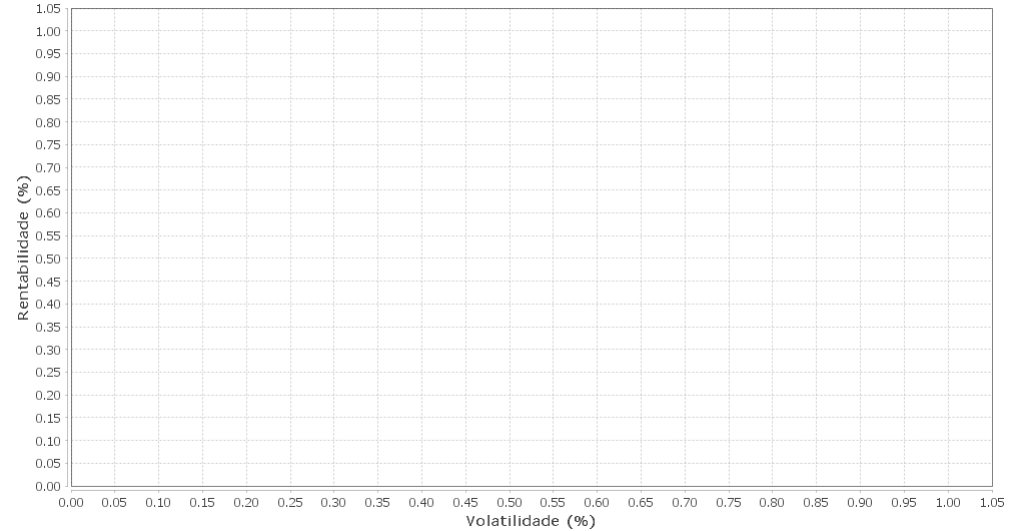
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Estratégia              | Volatilidade | VaR    | Rent.  | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|-------------------------|--------------|--------|--------|---------------|------------|
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,02         | 0,02   | 0,34   | 5.061,80      | 0,00       |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V         | Artigo 8º III           | 0,04         | -0,04  | -0,86  | 19.212,49     | 0,01       |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP             | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,07         | 0,02   | 0,33   | 24.702.849,91 | 14,58      |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,10         | 0,03   | 0,31   | 8.563.137,14  | 5,06       |
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO              | Artigo 8º IV, Alínea b  | 0,15         | 0,02   | -0,01  | 2.245.453,94  | 1,33       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF                      | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,17         | 0,03   | 0,31   | 6.289.870,22  | 3,71       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP              | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,05         | 0,11   | 0,01   | 7.310.595,31  | 4,32       |
| BB PREV RF IDKA2                                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,07         | 0,12   | 0,21   | 7.295.948,51  | 4,31       |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,33         | 0,12   | -0,30  | 1.452.279,64  | 0,86       |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO           | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,36         | 0,12   | -0,34  | 11.183.020,41 | 6,60       |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA                        | Artigo 7º IV, Alínea a  | 1,64         | 0,11   | -1,21  | 4.678.254,87  | 2,76       |
| BB PREV RF IRF-M                                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,66         | 0,15   | -0,47  | 4.469.928,54  | 2,64       |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,68         | 0,15   | -0,51  | 3.717.630,86  | 2,19       |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC                      | Artigo 7º VII, Alínea a | 1,70         | 0,17   | -0,18  | 1.288.633,47  | 0,76       |
| BB PREV ALOC FIC                                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,95         | 0,15   | -0,94  | 3.669.202,40  | 2,17       |
| INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II                   | Artigo 7º VII, Alínea a | 2,85         | 0,29   | -0,18  | 2.012.817,60  | 1,19       |
| BB PREV IMAB TPB                                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,13         | 0,30   | -2,48  | 4.746.288,36  | 2,80       |
| FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP                         | Artigo 7º III, Alínea a | 4,19         | 0,31   | -2,53  | 13.348.432,38 | 7,88       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO            | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,20         | 0,31   | -2,54  | 11.198.593,18 | 6,61       |
| BB PREV IMA-B5+                                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 6,45         | 0,46   | -4,10  | 3.963.186,27  | 2,34       |
| FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 6,58         | 0,47   | -4,16  | 7.375.306,59  | 4,35       |
| BB PREVID ALOC                                     | Artigo 8º II, Alínea a  | 13,38        | 1,43   | 0,83   | 4.814.671,69  | 2,84       |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 13,51        | 1,47   | 1,38   | 2.954.744,85  | 1,74       |
| BRADESCO FIA DIVIDENDOS                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 13,87        | 1,43   | -0,05  | 3.780.605,59  | 2,23       |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO          | Artigo 8º I, Alínea a   | 13,88        | 1,49   | 0,99   | 3.837.712,26  | 2,27       |
| BRADESCO F I A SELECTION                           | Artigo 8º II, Alínea a  | 14,37        | 1,42   | -1,45  | 4.593.836,36  | 2,71       |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS                | Artigo 8º II, Alínea a  | 15,18        | 1,72   | 2,99   | 1.370.056,86  | 0,81       |
| XP INVESTOR FIA                                    | Artigo 8º II, Alínea a  | 15,45        | 1,78   | 3,68   | 7.231.537,06  | 4,27       |
| PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | Artigo 7º VII, Alínea b | 102,40       | 12,05  | 33,24  | 6.896.805,72  | 4,07       |
| INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B            | Artigo 7º VII, Alínea a | 899,40       | 100,00 | 290,17 | 0,00          | 0,00       |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS