



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FERREIRA**  
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 15.01.2020.

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

78,25%

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	0,60	11,79	4.496.920,43	2,60	5.286.422.243,27	0,09
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,94	1,97	22,64	4.840.006,94	2,80	6.490.168.573,84	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,95	1,99	22,59	11.421.503,01	6,60	6.698.026.543,95	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,40	6,55	6.315.181,44	3,65	10.910.469.036,62	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	1,21	12,85	11.317.897,87	6,55	9.819.854.122,58	0,12
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,50	1,15	11,20	7.380.043,15	4,27	7.688.780.054,14	0,10
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,33	2,72	30,05	4.071.035,99	2,35	2.584.536.131,14	0,16
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	1,98	1,22	12,90	1.469.945,33	0,85	1.270.875.315,97	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,34	2,56	29,73	7.563.835,27	4,37	2.752.338.613,28	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,50	1,10	11,19	7.390.982,08	4,27	8.750.821.084,96	0,08
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,37	0,96	5,84	3.704.382,76	2,14	9.800.245.404,11	0,04
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,76	0,59	6,85	3.739.691,06	2,16	9.818.666.120,10	0,04
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,13</b>	<b>1,43</b>	<b>16,58</b>	<b>73.711.425,33</b>	<b>42,63</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	4,91	1,99	22,46	13.614.298,55	7,87	3.047.753.091,50	0,45
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>4,91</b>	<b>1,99</b>	<b>22,46</b>	<b>13.614.298,55</b>	<b>7,87</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	0,08	0,38	5,91	26.017.412,64	15,05	3.186.970.307,05	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,35	5,72	8.593.267,05	4,97	4.527.790.510,67	0,19

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,35	5,74	5.079,72	0,00	2.851.366.973,39	0,00
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3,69	-100,00	11,88	4.710.238,91	2,72	72.618.189,42	6,49
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>18,62</b>	<b>0,41</b>	<b>7,03</b>	<b>39.325.998,32</b>	<b>22,74</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	398,84	0,00	-97,29	0,00	0,00	861.375,60	0,00
GRAPHEN	ORLA	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,82	-0,43	0,81	1.283.107,53	0,74	76.280.354,27	1,68
RJI	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	4,89	-0,04	2,14	2.012.073,87	1,16	56.973.744,91	3,53
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>2,83</b>	<b>-0,19</b>	<b>-0,32</b>	<b>3.295.181,40</b>	<b>1,91</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	32,42	-0,09	33,13	5.374.221,72	3,11	126.253.130,47	4,26
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>32,42</b>	<b>-0,09</b>	<b>33,13</b>	<b>5.374.221,72</b>	<b>3,11</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>5,55</b>	<b>1,09</b>	<b>14,35</b>	<b>135.321.125,32</b>	<b>78,25</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**21,75%**

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	17,33	7,56	33,90	4.127.678,97	2,39	745.475.334,96	0,55
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>17,33</b>	<b>7,56</b>	<b>33,90</b>	<b>4.127.678,97</b>	<b>2,39</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	17,02	7,81	32,92	3.185.586,02	1,84	777.293.295,00	0,41
BRADESCO	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	17,97	7,19	27,57	4.924.314,28	2,85	977.683.776,93	0,50
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	17,02	7,23	23,60	4.054.048,63	2,34	2.952.097.775,20	0,14
BRADESCO	BEM	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	15,46	10,43	44,48	1.512.996,85	0,87	1.902.428.000,02	0,08
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	17,25	10,03	50,85	7.956.736,16	4,60	465.855.192,49	1,71
BB	BB	BB PREVID ALOC	17,09	8,20	31,96	5.209.304,11	3,01	447.972.852,26	1,16
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>16,69</b>	<b>8,48</b>	<b>35,53</b>	<b>26.842.986,05</b>	<b>15,52</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	0,84	-0,87	-0,98	19.046,21	0,01	1.570.941,90	1,21
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>0,84</b>	<b>-0,87</b>	<b>-0,98</b>	<b>19.046,21</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	1,00	4.365.325,29	2,52	267.517.064,75	1,63
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>1,03</b>	<b>-0,03</b>	<b>1,00</b>	<b>4.365.325,29</b>	<b>2,52</b>		

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

			Volatilid.	Rentab.	Rentab.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	a.a. (%)	Mês (%)	Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RJI	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2,24	0,08	1,20	2.247.346,13	1,30	70.417.771,66	3,19
		<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>	<b>2,24</b>	<b>0,08</b>	<b>1,20</b>	<b>2.247.346,13</b>	<b>1,30</b>		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	13,32	6,78	27,68	37.602.382,65	21,75		
		<b>Total</b>				<b>172.923.507,97</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	73.711.425,33	42,63	0,00	33,00	70,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	13.614.298,55	7,87	0,00	15,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	39.325.998,32	22,74	0,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.295.181,40	1,91	0,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	5.374.221,72	3,11	0,00	5,00	7,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>135.321.125,32</b>	<b>78,25</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	4.127.678,97	2,39	0,00	3,00	5,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.842.986,05	15,52	0,00	15,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.046,21	0,01	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.365.325,29	2,52	0,00	5,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.247.346,13	1,30	0,00	3,00	3,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>37.602.382,65</b>	<b>21,75</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 % do CDI	1,43 381,78	16,58 278,12	2,41 194,46	5,58 199,22	16,58 278,12	1.039.575,03	9.923.327,81
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,99 531,56	22,46 376,93	2,74 220,80	6,54 233,43	22,46 376,93	265.866,17	2.497.394,27
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,41 109,25	7,03 117,90	1,14 91,70	2,77 98,78	7,03 117,90	157.898,99	2.577.601,10
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,19 -50,68	-0,32 -5,35	-0,59 -47,44	-0,75 -26,67	-0,32 -5,35	-6.269,67	-10.533,93
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,09 -24,62	33,13 555,92	32,81 2.647,23	34,34 1.226,64	33,13 555,92	-4.955,97	1.716.210,86
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,56 0,71	33,90 2,32	11,66 1,25	16,39 1,85	33,90 2,32	289.966,71	1.045.030,64
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,48 1,63	35,53 3,94	12,35 1,95	18,08 3,54	35,53 3,94	2.097.533,64	7.036.618,06
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,87 -7,71	-0,98 -32,56	-2,63 -13,03	-5,06 -19,60	-0,98 -32,56	-166,28	-187,75
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,03 -6,88	1,00 -30,59	-0,09 -10,50	0,21 -14,33	1,00 -30,59	-1.204,08	43.125,12
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,08 -6,76	1,20 -30,39	0,05 -10,35	-0,01 -14,55	1,20 -30,39	1.892,19	26.616,39
						3.840.136,73	24.855.202,57

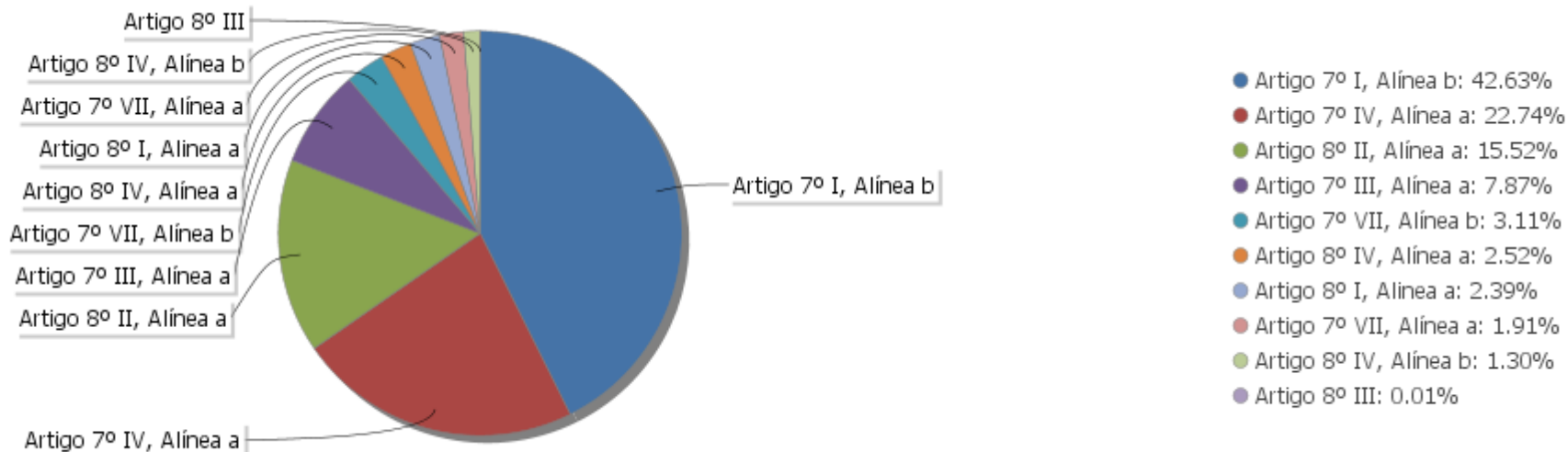
**Análise de Liquidez**

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	161.555.939,81	93,43	161.555.939,81	93,43
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	161.555.939,81	93,43
acima de 365 dias	11.367.568,16	6,57	172.923.507,97	100,00

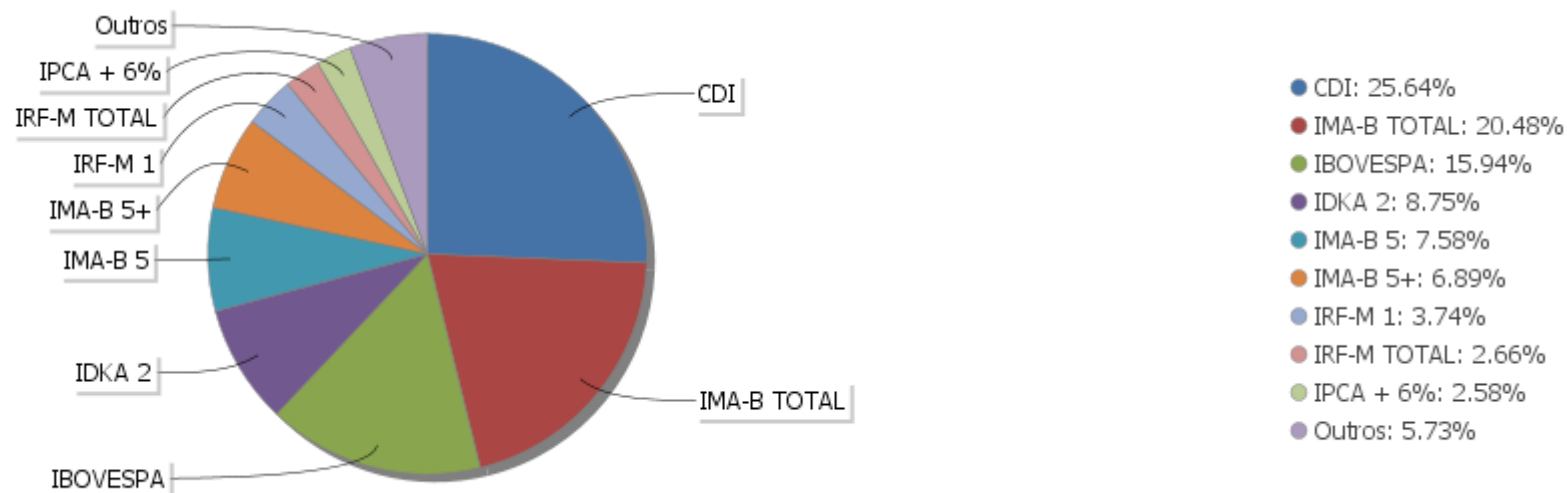


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

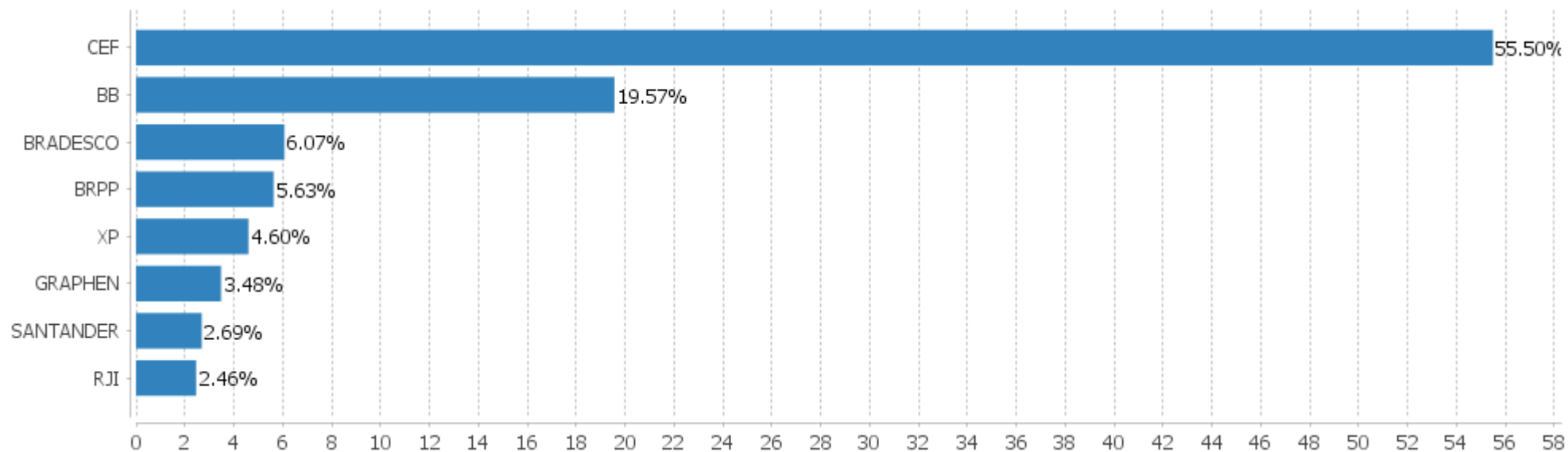


Alocação Por Estratégia



## 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	2,27	17,05
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	2,34	-0,76	-0,87	-0,13	1,04	1,82	0,27	-0,46	1,25	1,17	-0,52	0,63	6,46
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

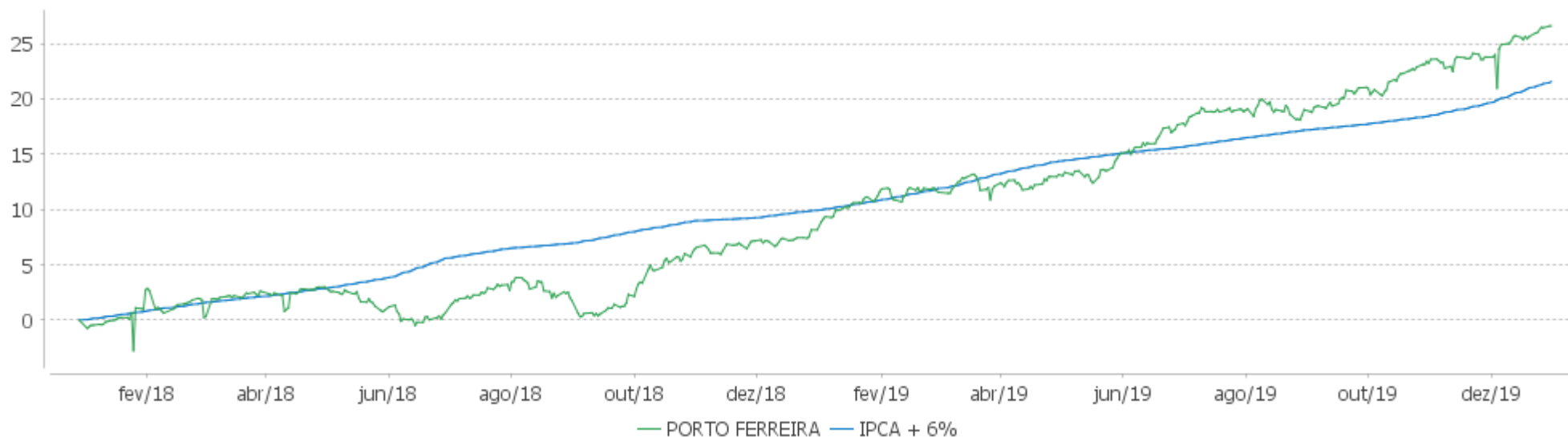
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

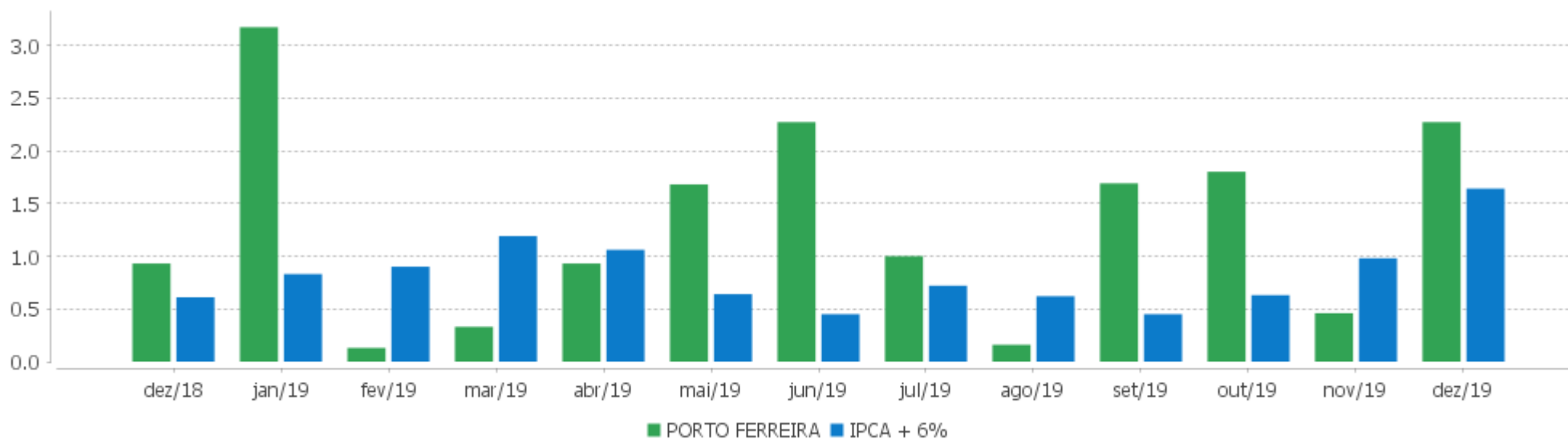
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	54,17	03 meses	4,59	3,28	1,31	8,38
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	45,83	06 meses	7,60	5,15	2,45	6,50
			12 meses	17,05	10,59	6,46	5,56
			24 meses	26,60	21,56	5,04	6,74
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-2,04	2018-05	Desde 29/12/2017	26,60	21,56	5,04	6,74

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 PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,35 94,44	5,74 96,34	1,14 91,79	2,65 94,83	5,74 96,34	12,44 97,46	23,77 99,24
FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP % do CDI	0,38 100,28	5,91 99,22	1,20 97,14	2,76 98,76	5,91 99,22	12,45 97,58	23,60 98,52
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,35 93,90	5,72 95,89	1,11 89,85	2,62 93,73	5,72 95,89	12,30 96,38	23,46 97,95
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,68 -1,32	11,88 -11,07	0,81 -2,04	3,01 -3,71	11,88 -11,07	-11,48 -50,48	
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	-0,09 -24,62	33,13 555,92	32,81 2.647,23	34,34 1.226,64	33,13 555,92	-2,02 -15,84	-29,05 -121,25
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II % do CDI	-0,04 -9,86	2,14 35,98	-0,35 -27,88	0,45 15,90	2,14 35,98	62,35 488,51	-55,99 -233,72
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B % do CDI	156,45 41.754,74	-97,29 -1.632,40	0,00 0,00	-89,61 -3.200,99	-97,29 -1.632,40	-97,29 -762,22	
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,43 -114,44	0,81 13,53	-0,83 -67,37	-1,33 -47,38	0,81 13,53	1.138,73 8.921,50	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO 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
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO 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
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,22 -0,02	12,90 -0,26	2,56 -0,06	5,35 -0,12	12,90 -0,26	23,79 -0,53	39,12 -0,84
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,05	11,20 -0,62	2,62 0,16	5,15 -0,10	11,20 -0,62	21,46 -1,27	36,52 -2,92
BB PREV ALOC FIC 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
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA 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 IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,10 -0,10	11,19 -0,63	2,40 -0,06	4,92 -0,33	11,19 -0,63	21,53 -1,20	36,53 -2,90
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,60 -0,02	11,79 -0,24	1,81 -0,05	4,61 -0,11	11,79 -0,24	23,56 -0,49	41,98 -0,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,02	6,55 -0,21	1,33 -0,05	3,22 -0,11	6,55 -0,21	13,80 -0,40	26,25 -0,66

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

BB PREV IMAB TPB	1,97	22,64	2,78	6,61	22,64	38,29	55,61
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,31	-0,07	-0,11	-0,31	-0,71	-1,18
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	2,56	29,73	2,85	7,41	29,73	49,17	67,72
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,05	-0,63	-0,17	-0,23	-0,63	-1,29	-1,92
BB PREV IMA-B5+	2,72	30,05	3,10	7,66	30,05	49,74	67,95
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,12	-0,32	0,08	0,03	-0,32	-0,72	-1,68
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	1,99	22,46	2,74	6,54	22,46	38,31	55,40
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,49	-0,11	-0,19	-0,49	-0,70	-1,39
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	7,23	23,60	8,78	10,09	23,60	49,77	96,01
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,75	-21,56	-5,50	-12,24	-21,56	-18,55	-14,88
BB PREVID ALOC	8,20	31,96	11,92	15,66	31,96	53,33	85,22
Var. IBOVESPA p.p.	1,35	0,37	1,52	1,13	0,37	1,96	-6,79
BRADESCO F I A SELECTION	7,19	27,57	9,30	14,65	27,57	60,83	115,51
Var. IBOVESPA p.p.	0,35	-4,02	-1,10	0,11	-4,02	9,47	23,50
XP INVESTOR FI DE ACOES	10,03	50,85	16,48	25,92	50,85	82,02	133,61
Var. IBOVESPA p.p.	3,18	19,26	6,07	11,38	19,26	30,66	41,59
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	7,81	32,92	11,38	16,66	32,92	52,79	108,92
Var. IBOVESPA p.p.	0,96	1,33	0,97	2,12	1,33	1,42	16,90
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	10,43	44,48	15,15	25,87	44,48	78,58	153,44
Var. IBOVESPA p.p.	3,58	12,90	4,75	11,33	12,90	27,22	61,42
BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	7,56	33,90	11,66	16,39	33,90	52,17	96,00
Var. IBOVESPA p.p.	0,71	2,32	1,25	1,85	2,32	0,81	3,98
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-0,87	-0,98	-2,63	-5,06	-0,98	-94,81	-94,17
% do CDI	-231,12	-16,38	-211,91	-180,73	-16,38	-742,77	-393,08
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,08	1,20	0,05	-0,01	1,20	16,82	-20,32
Var. IFIX p.p.	-10,55	-34,78	-19,07	-21,77	-34,78	-26,80	-91,81
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	-0,03	1,00	-0,09	0,21	1,00	0,52	-21,52
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,67	-9,59	-3,37	-4,94	-9,59	-21,04	-54,08
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
<b>Renda Fixa</b>							
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
<b>Renda Variável</b>							
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							
Índice Dividendos - IDIV	9,99	45,16	14,28	22,33	45,16	68,32	110,90
<b>Indicadores Econômicos</b>							
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	7,32	3,09	2,80	7,32	15,42	14,81
SELIC	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,77	23,98
<b>Meta Atuarial</b>							
IPCA + 4%	1,48	8,50	2,79	4,12	8,50	17,02	25,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	1,56	9,54	3,04	4,63	9,54	19,28	28,86
IPCA + 5,5%	1,60	10,07	3,16	4,89	10,07	20,42	30,70
IPCA + 5,89%	1,63	10,47	3,26	5,09	10,47	21,31	32,15
IPCA + 6%	1,64	10,59	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56
INPC + 4%	1,55	8,68	2,83	4,06	8,68	16,87	24,00
INPC + 6%	1,71	10,78	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

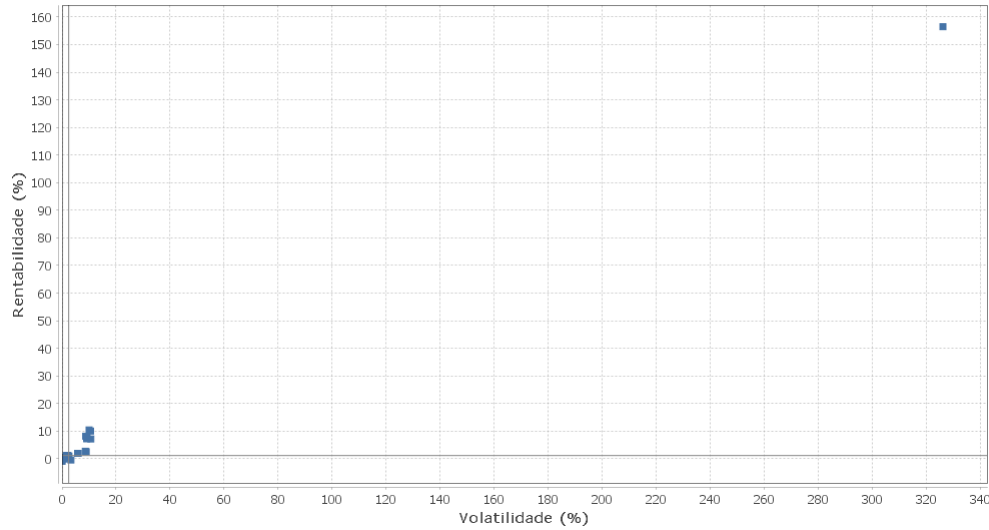
## Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
05/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	13.000,00	0,00	3.298,69785100	3,9409490000
06/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	334.380,09	0,00	84.819,00312400	3,9422780000
11/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	1.518.000,00	0,00	384.846,57728600	3,9444290000
17/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	0,00	782.000,00	198.156,23473900	3,9463810000
17/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	0,00	33.000,00	8.362,09213900	3,9463810000
26/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	133.392,13	0,00	33.764,31271100	3,9506840000
26/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	21.831,39	0,00	5.525,97727300	3,9506840000
30/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	12.792,00	0,00	3.236,63653900	3,9522510000
30/12/2019	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	400,00	0,00	101,20814600	3,9522510000
31/12/2019	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,01	0,00	0,00450664	2,2189470000

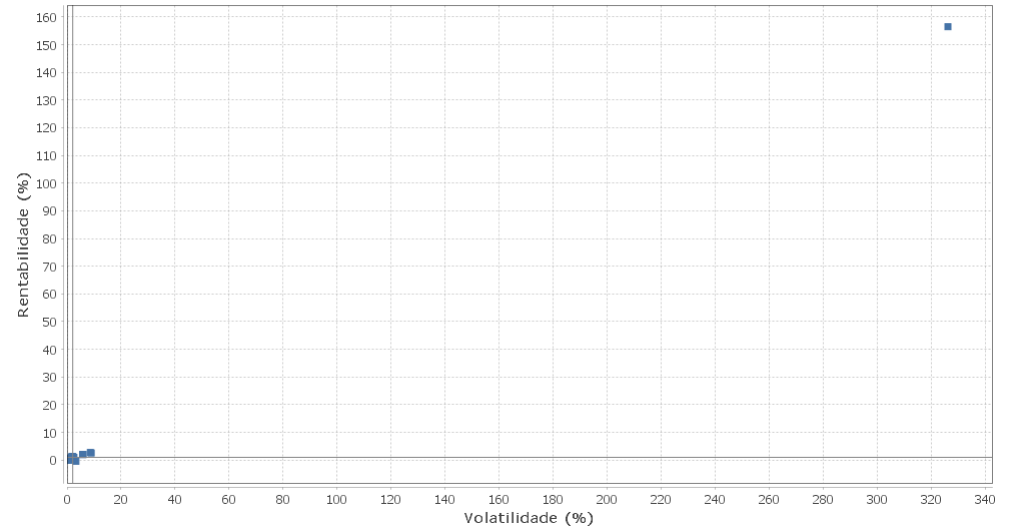
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

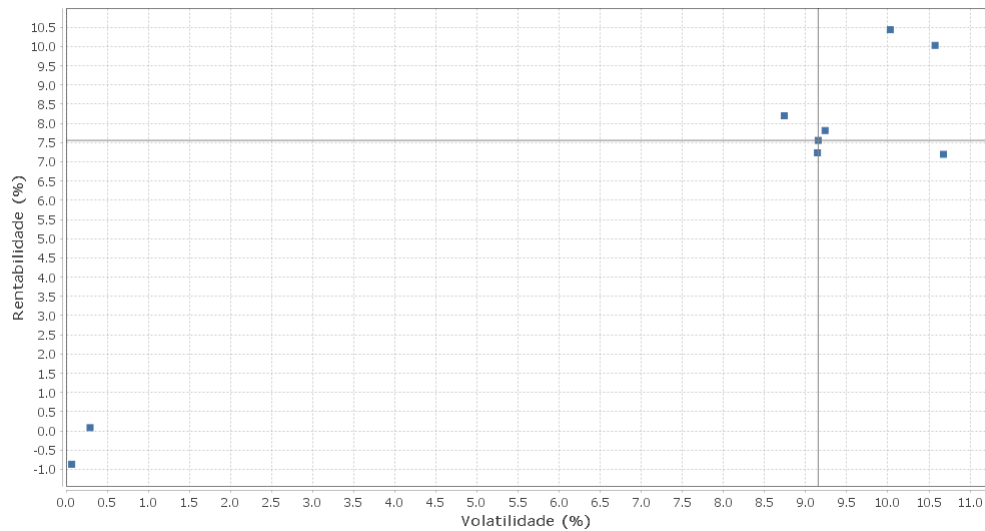
PORTO FERREIRA - No Mês



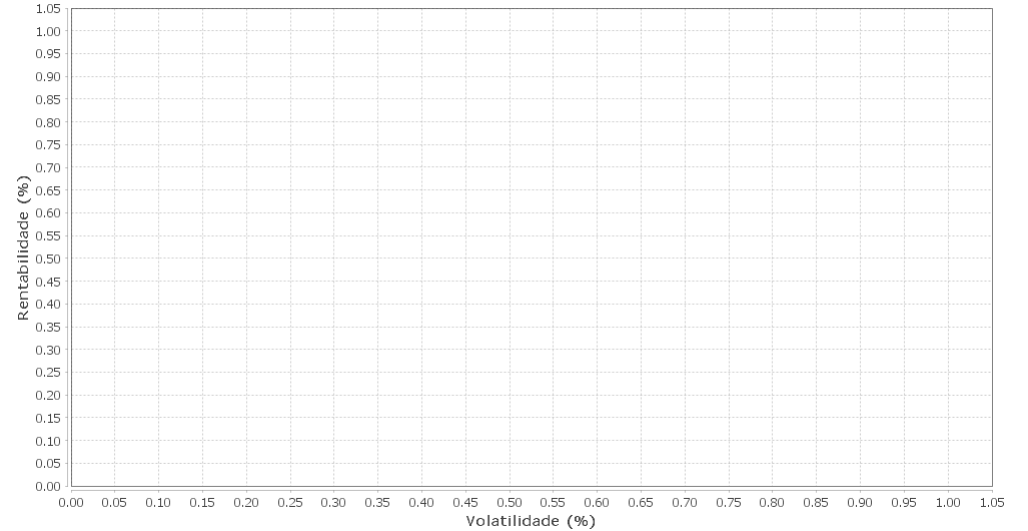
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	8.593.267,05	4,97
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	5.079,72	0,00
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,07	-0,03	-0,87	19.046,21	0,01
FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,03	0,38	26.017.412,64	15,05
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	Artigo 7º VII, Alínea a	0,13	0,01	-0,04	2.012.073,87	1,16
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,40	6.315.181,44	3,65
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,29	0,03	0,08	2.247.346,13	1,30
PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,82	0,08	-0,09	5.374.221,72	3,11
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,21	1,10	7.390.982,08	4,27
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,58	0,22	1,15	7.380.043,15	4,27
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,23	0,59	3.739.691,06	2,16
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,23	0,60	4.496.920,43	2,60
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	0,28	1,22	1.469.945,33	0,85
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	0,28	1,21	11.317.897,87	6,55
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,38	0,28	0,68	4.710.238,91	2,72
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	0,31	0,96	3.704.382,76	2,14
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	3,29	0,32	-0,43	1.283.107,53	0,74
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	0,70	1,97	4.840.006,94	2,80
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,88	0,70	1,99	13.614.298,55	7,87
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,90	0,70	1,99	11.421.503,01	6,60
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	8,64	1,02	2,72	4.071.035,99	2,35
BB PREVID ALOC	Artigo 8º II, Alínea a	8,74	1,28	8,20	5.209.304,11	3,01
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,97	1,05	2,56	7.563.835,27	4,37
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	9,14	1,28	7,23	4.054.048,63	2,34
BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º I, Alínea a	9,15	1,30	7,56	4.127.678,97	2,39
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	9,24	1,32	7,81	3.185.586,02	1,84
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	10,03	1,51	10,43	1.512.996,85	0,87
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	10,57	1,55	10,03	7.956.736,16	4,60
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	10,68	1,44	7,19	4.924.314,28	2,85
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B	Artigo 7º VII, Alínea a	326,24	38,29	156,45	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

No respectivo mês, dezembro de 2019, observar que o percentual alocado no Artigo 8, Inciso II, Alínea A (15,52% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos.