



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA
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 19.02.2020.

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

78,55%

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	2,06	0,85	0,85	4.535.336,37	2,59	5.205.249.143,09	0,09
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,26	0,26	4.852.590,36	2,77	6.477.324.446,92	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,25	0,25	11.449.675,41	6,54	6.604.088.892,56	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,42	0,42	6.341.867,67	3,62	10.529.932.746,92	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,97	0,54	0,54	11.379.478,79	6,50	9.706.276.068,00	0,12
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,49	0,38	0,38	7.408.455,43	4,23	6.900.045.813,02	0,11
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,27	0,05	0,05	4.072.965,44	2,33	2.287.850.661,28	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	1,96	0,54	0,54	1.477.891,74	0,84	1.150.142.375,78	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,28	-0,04	-0,04	7.560.919,53	4,32	2.270.256.483,13	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,50	0,46	0,46	7.424.770,23	4,24	8.791.015.868,25	0,08
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,35	0,49	0,49	3.722.380,16	2,13	10.446.730.359,40	0,04
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,67	0,82	0,82	3.770.330,39	2,15	10.136.705.212,45	0,04
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,11	0,39	0,39	73.996.661,52	42,26		

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	4,88	0,23	0,23	13.645.539,79	7,79	3.029.770.455,34	0,45
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,88	0,23	0,23	13.645.539,79	7,79		

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	0,09	0,39	0,39	28.162.671,29	16,08	3.449.563.810,54	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,37	0,37	8.625.131,52	4,93	5.345.385.558,02	0,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,35	0,35	5.097,49	0,00	2.903.514.199,57	0,00
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3,58	NaN	0,24	4.721.662,44	2,70	72.795.283,72	6,49
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			18,62	0,37	0,37	41.514.562,74	23,71		

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	1.001,07	0,00	-99,99	0,00	0,00	861.375,60	0,00
GRAPHEN	ORLA	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,06	-0,11	-0,11	1.281.729,73	0,73	76.198.443,05	1,68
RJI	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	4,89	-0,07	-0,07	2.010.757,90	1,15	56.936.481,86	3,53
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			2,86	-0,08	-0,08	3.292.487,63	1,88		

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	32,76	-5,15	-5,15	5.097.480,83	2,91	113.799.295,33	4,48
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			32,76	-5,15	-5,15	5.097.480,83	2,91		
Renda Fixa			5,55	0,13	0,13	137.546.732,51	78,55		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,45%

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 PREV ACOES GV	17,55	-1,09	-1,09	4.082.819,66	2,33	826.438.302,84	0,49
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			17,55	-1,09	-1,09	4.082.819,66	2,33		

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	3.164.566,33	1,81	767.681.560,64	0,41
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	18,43	-1,29	-1,29	4.860.835,43	2,78	971.708.914,14	0,50
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA DIVIDENDOS	17,26	-2,72	-2,72	3.943.934,73	2,25	2.730.990.987,66	0,14
BRAM	BEM	BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	15,95	1,61	1,61	1.537.418,46	0,88	2.245.635.949,92	0,07
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	17,82	3,18	3,18	8.209.879,70	4,69	479.111.042,60	1,71
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	17,15	-1,38	-1,38	5.137.284,93	2,93	427.681.839,30	1,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,07	0,04	0,04	26.853.919,58	15,34		

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	8,34	7,82	7,82	20.535,57	0,01	1.693.785,78	1,21
Sub-total Artigo 8º III			8,34	7,82	7,82	20.535,57	0,01		

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 MULTISTRATEGIA	0,41	-0,03	-0,03	4.363.929,87	2,49	267.517.064,75	1,63
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			0,41	-0,03	-0,03	4.363.929,87	2,49		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RJI	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2,23	-0,08	-0,08	2.245.631,97	1,28	70.364.060,65	3,19
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	2,23	-0,08	-0,08	2.245.631,97	1,28		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	13,67	-0,09	-0,09	37.566.836,65	21,45		
		Total				175.113.569,16	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	73.996.661,52	42,26	0,00	40,00	70,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	13.645.539,79	7,79	0,00	10,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	41.514.562,74	23,71	0,00	14,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.292.487,63	1,88	0,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	5.097.480,83	2,91	0,00	4,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	137.546.732,51	78,55				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	4.082.819,66	2,33	0,00	3,00	5,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.853.919,58	15,34	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	20.535,57	0,01	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.363.929,87	2,49	0,00	3,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.245.631,97	1,28	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	37.566.836,65	21,45				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

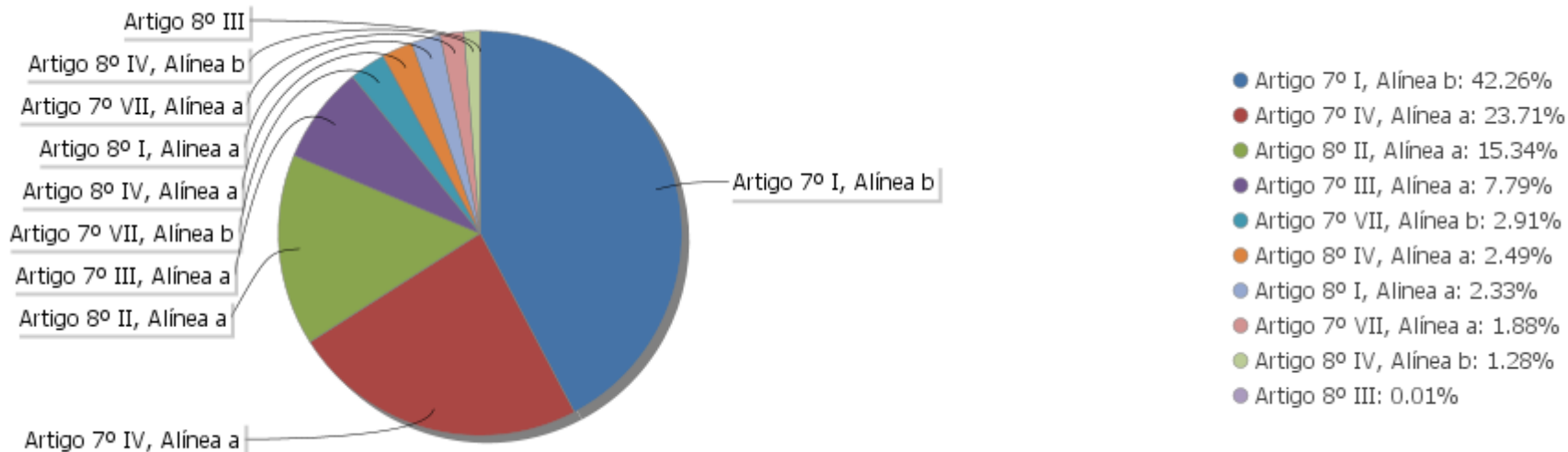
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,39 102,75	0,39 102,75	0,46 40,69	4,83 185,44	13,83 239,09	285.236,19	285.236,19
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,23 60,93	0,23 60,93	-0,36 -31,74	5,45 209,34	17,66 305,34	31.241,24	31.241,24
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,37 97,19	0,37 97,19	0,91 79,95	2,55 98,03	6,29 108,74	145.808,89	145.808,89
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,08 -21,71	-0,08 -21,71	-0,46 -40,19	-0,69 -26,41	-0,71 -12,36	-2.693,77	-2.693,77
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-5,15 -1.367,26	-5,15 -1.367,26	26,27 2.312,17	27,60 1.059,69	26,48 457,77	-276.740,89	-276.740,89
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,09 0,54	-1,09 0,54	7,44 1,34	14,37 2,63	19,95 3,14	-44.859,31	-44.859,31
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,04 1,67	0,04 1,67	9,88 3,78	15,86 4,13	24,93 8,13	10.933,53	10.933,53
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	7,82 9,45	7,82 9,45	5,96 -0,14	3,21 -8,53	6,62 -10,19	1.489,36	1.489,36
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,03 1,60	-0,03 1,60	-0,09 -6,19	0,21 -11,53	0,04 -16,76	-1.395,42	-1.395,42
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 1,55	-0,08 1,55	0,00 -6,10	-0,01 -11,74	1,26 -15,54	-1.714,16	-1.714,16
						147.305,66	147.305,66

Análise de Liquidez

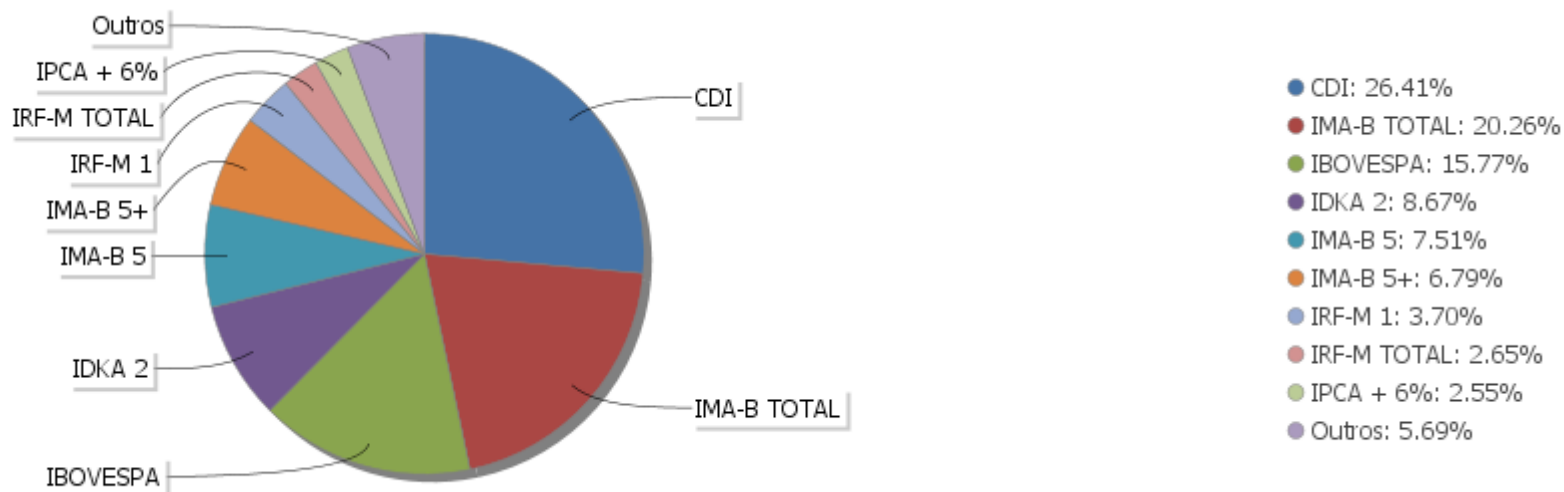
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	164.012.696,16	93,66	164.012.696,16	93,66
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	164.012.696,16	93,66
acima de 365 dias	11.100.873,00	6,34	175.113.569,16	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

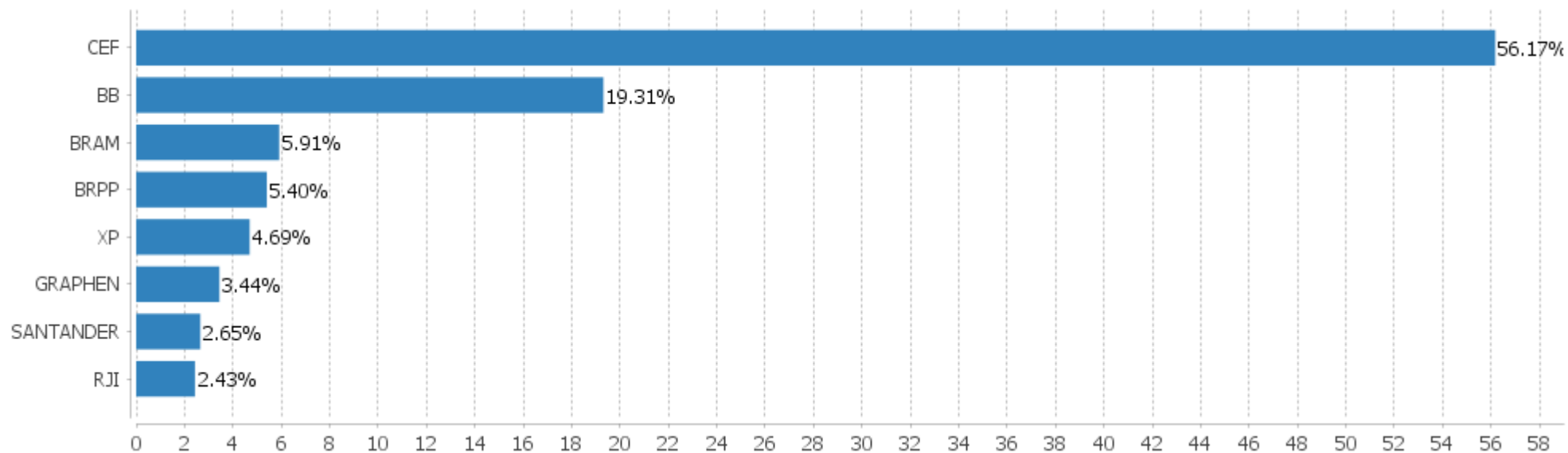


Alocação Por Estratégia



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	0,09												0,09
IPCA + 5,86%	0,71												0,71
p.p. indexador	-0,62												-0,62
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

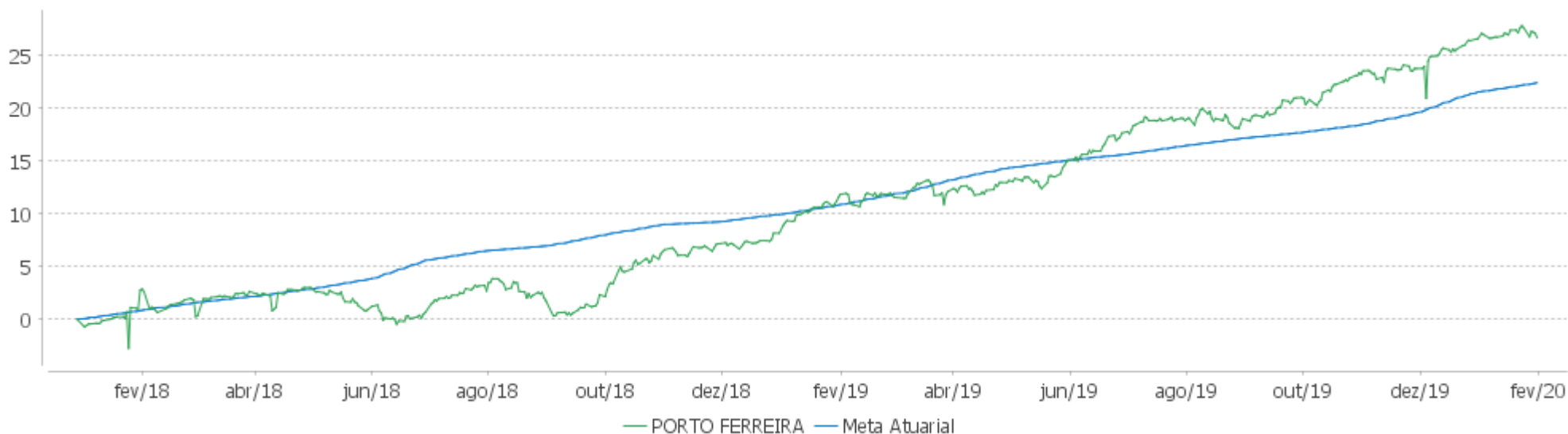
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

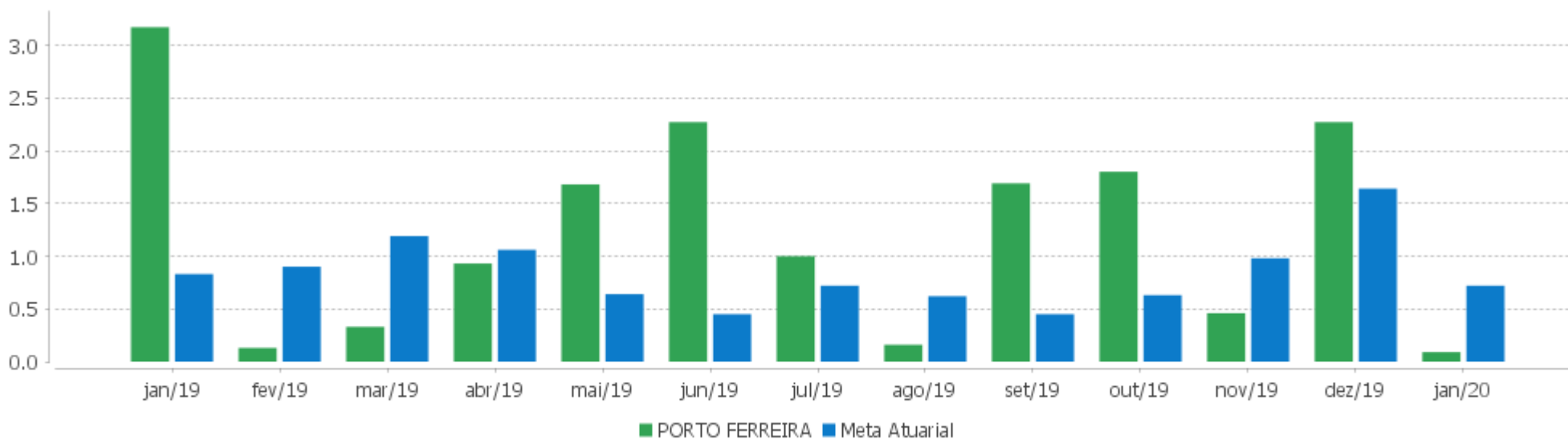
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	52,00	03 meses	2,83	3,36	-0,53	8,51
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	48,00	06 meses	6,63	5,13	1,50	6,63
			12 meses	13,55	10,46	3,10	5,59
			24 meses	23,35	21,45	1,91	5,52
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-2,04	2018-05	Desde 29/12/2017	26,71	22,42	4,29	6,65

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
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	-5,15 -1.367,26	-5,15 -1.367,26	26,27 2.312,17	27,60 1.059,69	26,48 457,77	-6,94 -55,40	-33,09 -143,32
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23 -0,03	0,23 -0,03	-0,36 -0,12	5,45 -0,19	17,66 -0,45	34,19 -0,59	52,87 -1,45
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO 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 IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO 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
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,02	0,54 -0,02	1,46 -0,05	4,92 -0,11	11,81 -0,25	22,85 -0,52	38,29 -0,83
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,38 -0,15	0,38 -0,15	1,75 -0,01	4,52 -0,22	10,29 -0,73	20,76 -1,68	35,58 -3,10
BB PREV ALOC FIC 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
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA 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 IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,46 -0,08	0,46 -0,08	1,57 -0,19	4,44 -0,31	10,30 -0,72	20,94 -1,51	35,72 -2,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,14 -0,05	2,93 -0,11	6,40 -0,22	13,64 -0,40	25,20 -0,64
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,85 -0,02	0,85 -0,02	0,98 -0,06	4,38 -0,12	11,22 -0,24	23,04 -0,50	39,99 -0,96
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 -0,00	0,26 -0,00	-0,30 -0,06	5,54 -0,10	17,83 -0,29	34,11 -0,67	53,19 -1,13
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04 -0,07	-0,04 -0,07	-1,75 -0,21	5,77 -0,31	21,74 -0,59	42,13 -1,28	64,08 -1,90
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,05 0,01	0,05 0,01	-1,45 0,09	6,13 0,06	22,08 -0,25	42,79 -0,62	64,47 -1,51
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,35 92,89	0,35 92,89	1,05 92,35	2,45 94,13	5,55 95,98	12,19 97,29	22,86 99,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,37 98,46	0,37 98,46	1,03 91,06	2,44 93,73	5,55 95,93	12,08 96,40	22,61 97,91
FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	0,39	0,39	1,09	2,59	5,76	12,25	22,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	102,58	102,58	96,25	99,45	99,65	97,76	98,44
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,02	0,24 -0,02	-0,29 -0,05	2,54 -3,10	8,67 -9,45	-12,46 -47,24	
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II % do CDI	-0,07 -17,37	-0,07 -17,37	-0,28 -24,92	0,31 12,07	2,08 35,92	2,31 18,44	-56,32 -243,91
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B % do CDI	-99,99 -26.549,06	-99,99 -26.549,06	-99,90 -8.794,21	-100,00 -3.839,87	-100,00 -1.728,76	-100,00 -797,95	
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,11 -28,51	-0,11 -28,51	-0,71 -62,87	-1,83 -70,17	-0,12 -2,14	1.149,44 9.171,95	
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	-0,08 3,69	-0,08 3,69	0,00 -10,22	-0,01 -15,71	1,26 -26,44	16,85 -17,81	-20,34 -79,40
BRADERCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,72 -1,13	-2,72 -1,13	4,27 -6,52	7,15 -10,00	10,99 -16,02	30,89 -19,87	72,69 -18,46
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,38 0,25	-1,38 0,25	7,59 1,49	13,66 1,92	19,47 2,66	37,50 3,52	73,62 -2,28
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-1,29 0,34	-1,29 0,34	4,28 -1,82	11,26 -0,48	18,91 2,11	40,76 6,78	94,56 18,65
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	3,18 4,81	3,18 4,81	17,70 11,60	24,85 13,12	41,22 24,41	72,27 38,29	122,77 46,86
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
BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	1,61 3,24	1,61 3,24	15,57 9,47	21,71 9,97	35,76 18,96	71,51 37,54	134,27 58,36
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	7,82 2.076,27	7,82 2.076,27	5,96 524,84	3,21 123,23	6,62 114,41	-94,41 -753,32	-93,79 -406,22
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,03 -0,75	-0,03 -0,75	-0,09 -3,46	0,21 -4,94	0,04 -10,43	0,63 -20,84	-21,44 -53,77
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-1,09 0,54	-1,09 0,54	7,44 1,34	14,37 2,63	19,95 3,14	39,21 5,23	81,48 5,57
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
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			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	7,82	15,10	14,63
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64
IPCA + 5,5%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33
INPC + 4%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

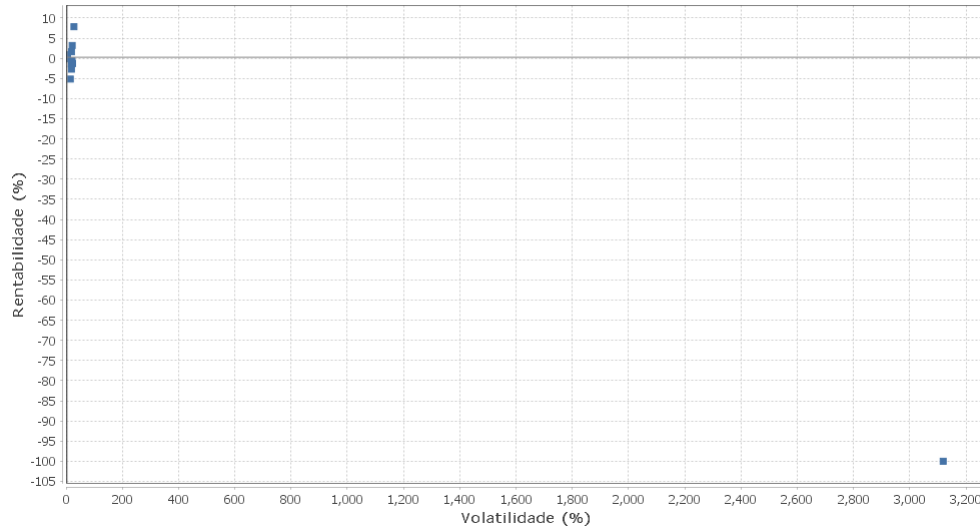
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
08/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	170.186,21	0,00	43.012,40915000	3,9566770000
15/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	238.000,00	0,00	60.094,75781800	3,9604120000
21/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	100,00	0,00	25,23366300	3,9629600000
21/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	81.969,32	0,00	20.683,86256700	3,9629600000
24/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	500,00	0,00	126,10499500	3,9649500000
27/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	45.000,00	0,00	11.347,09997100	3,9657710000
27/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	1.482.000,00	0,00	373.697,82571900	3,9657710000
31/01/2020	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	25.000,00	0,00	6.300,13648600	3,9681680000

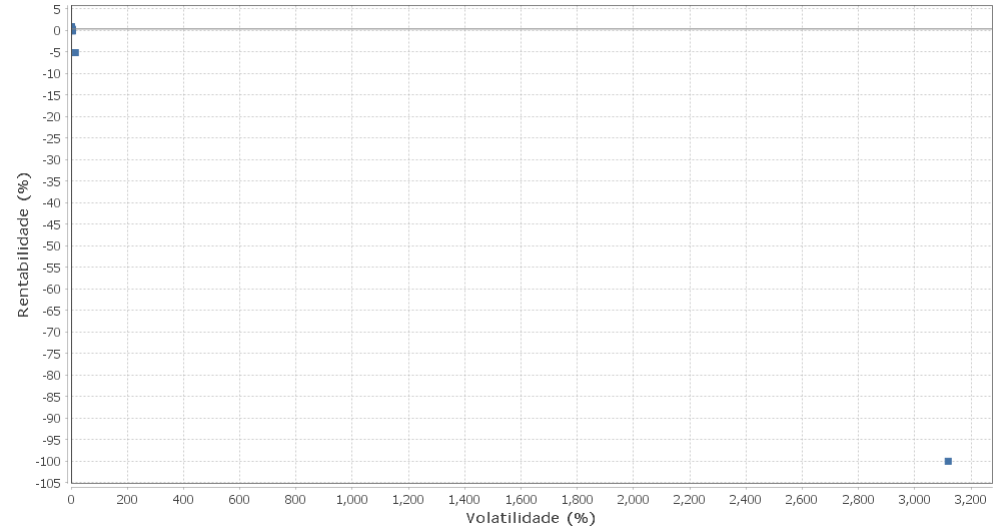
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

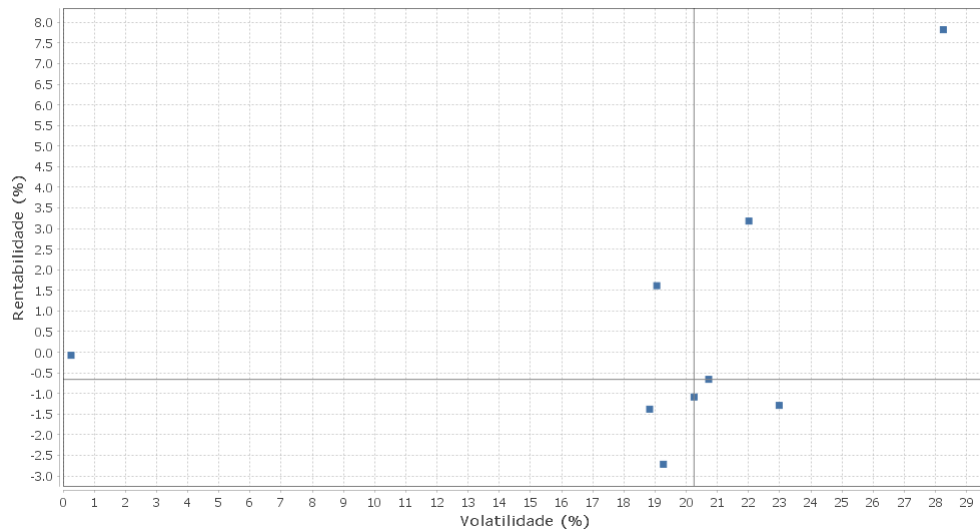
PORTO FERREIRA - No Mês



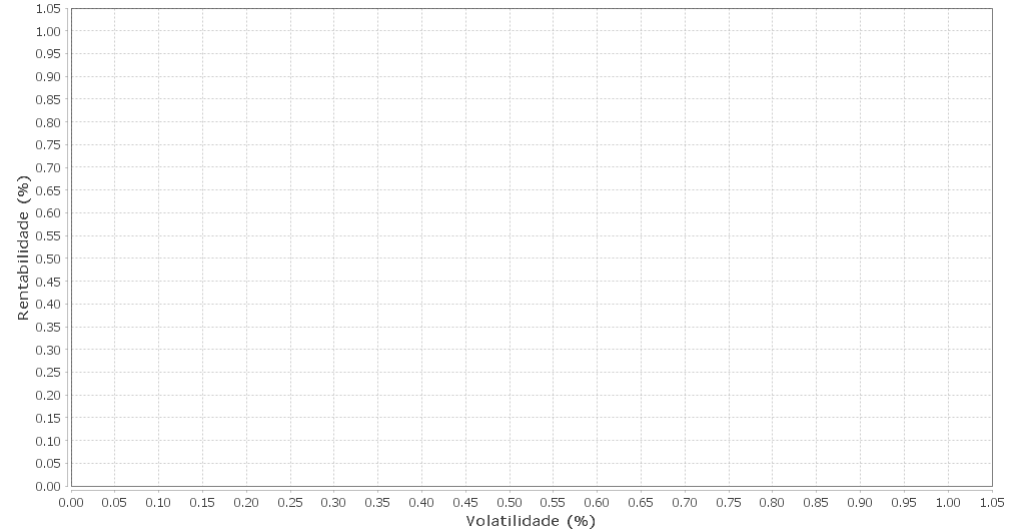
Renda Fixa - No Mês



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	0,37	8.625.131,52	4,93
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	5.097,49	0,00
FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,39	28.162.671,29	16,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	6.341.867,67	3,62
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	Artigo 7º VII, Alínea a	0,22	0,02	-0,07	2.010.757,90	1,15
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,26	0,02	-0,08	2.245.631,97	1,28
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,15	0,14	0,38	7.408.455,43	4,23
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,16	0,14	0,46	7.424.770,23	4,24
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,18	0,82	3.770.330,39	2,15
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,54	1.477.891,74	0,84
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,54	11.379.478,79	6,50
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,18	0,85	4.535.336,37	2,59
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	0,18	0,49	3.722.380,16	2,13
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,59	0,18	0,24	4.721.662,44	2,70
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	0,37	0,26	4.852.590,36	2,77
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	3,50	0,37	0,23	13.645.539,79	7,79
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	0,37	0,25	11.449.675,41	6,54
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	4,38	0,45	-0,11	1.281.729,73	0,73
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	5,45	0,57	0,05	4.072.965,44	2,33
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,53	0,57	-0,04	7.560.919,53	4,32
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	15,31	1,35	-5,15	5.097.480,83	2,91
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,82	1,89	-1,38	5.137.284,93	2,93
BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	19,05	2,05	1,61	1.537.418,46	0,88
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	19,27	1,87	-2,72	3.943.934,73	2,25
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	20,25	2,05	-1,09	4.082.819,66	2,33
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	20,72	2,12	-0,66	3.164.566,33	1,81
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	22,01	2,42	3,18	8.209.879,70	4,69
BRADERCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	2,32	-1,29	4.860.835,43	2,78
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	28,25	3,27	7,82	20.535,57	0,01
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B	Artigo 7º VII, Alínea a	3.118,57	281,25	-99,99	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS