



LDB
EMPRESAS

PIRACAIA
FEVEREIRO 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 19.03.2020.

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 68,32%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,36	0,49	1,76	20.457.267,18	22,58
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,49	1,76	20.457.267,18	22,58

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	1,97	0,63	1,17	74.102,15	0,08	1.660.772.359,14	0,00
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA PRE FIXADO LP FICFI	2,05	0,63	1,49	1.384.507,43	1,53	190.190.323,67	0,73
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,45	0,62	0,95	11.984.634,20	13,23	1.404.842.027,82	0,85
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	4,90	0,43	0,66	4.554.391,30	5,03	748.077.616,53	0,61
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,44	0,69	3.521,87	0,00	6.609.422.706,56	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,36	0,79	353.653,32	0,39	10.513.960.188,40	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	0,63	1,18	1.400.922,17	1,55	9.698.235.388,71	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,51	0,60	1,06	294.350,54	0,32	8.419.154.798,69	0,00
BB	BB	BB PREV IPCA III	1,82	0,55	0,97	3.985.706,22	4,40	880.076.235,05	0,45
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS	3,39	0,70	1,51	1.518.179,00	1,68	1.397.669.964,29	0,11
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,61	0,57	0,97	25.553.968,20	28,21		

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	0,44	0,67	57.289,15	0,06	3.035.883.583,88	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,88	0,44	0,67	57.289,15	0,06		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,69	0,26	0,60	7.444.593,04	8,22	5.092.614.949,01	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,66	0,59	0,75	8.380.993,15	9,25	834.144.361,75	1,00
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,73	0,43	0,67	15.825.586,19	17,47		
Renda Fixa			1,87	0,52	1,17	61.894.110,72	68,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,00%

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
ITAU	ITAU	ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	19,05	-7,81	-8,75	50.948,47	0,06	60.627.826,15	0,08
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,36	-8,60	-8,14	295.153,71	0,33	1.542.999.030,98	0,02
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	16,55	-5,96	-5,59	5.134.836,03	5,67	405.593.691,50	1,27
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,26	-9,79	-9,96	6.946.258,03	7,67	4.106.559.997,95	0,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19,26	-9,27	-7,93	1.637.951,96	1,81	2.262.526.519,52	0,07
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	17,97	-8,00	-8,00	920.010,21	1,02	1.674.749.361,15	0,05
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	15,82	-7,40	-7,40	926.021,44	1,02	180.305.968,92	0,51
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,51	-8,03	-7,71	15.911.179,85	17,56		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	14,85	-7,44	-7,10	1.839.278,12	2,03	393.099.384,46	0,47
CEF	CEF	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	1,85	0,27	0,58	2.277.487,24	2,51	501.837.357,44	0,45
Sub-total Artigo 8º III			5,84	-3,33	-3,33	4.116.765,36	4,54		

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
VINCI	BEM	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	28,14	-0,92	-2,01	464.898,11	0,51	49.572.194,84	0,94
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			28,14	-0,92	-2,01	464.898,11	0,51		

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
KINEA	KINEA	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	25,75	-0,91	-0,34	344.566,63	0,38	83.294.011,64	0,41
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			25,75	-0,91	-0,34	344.566,63	0,38		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	14,24	-6,91	-6,63	20.837.409,95	23,00
---	-------	-------	-------	---------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,68%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,34	-5,69	0,46	4.090.651,48	4,52	866.229.995,42	0,47
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	14,55	-5,24	1,37	3.771.479,39	4,16	849.143.050,83	0,44
Sub-total Artigo 9º A, III			16,30	-5,47	0,89	7.862.130,87	8,68		
Investimentos no Exterior			16,30	-5,47	0,89	7.862.130,87	8,68		
Total						90.593.651,54	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	20.457.267,18	22,58	0,00	23,47	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	25.553.968,20	28,21	0,00	32,23	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	57.289,15	0,06	0,00	0,07	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	15.825.586,19	17,47	0,00	15,70	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	61.894.110,72	68,32				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	15.911.179,85	17,56	0,00	18,32	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.116.765,36	4,54	0,00	4,49	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	464.898,11	0,51	0,00	0,51	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	344.566,63	0,38	0,00	0,40	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	20.837.409,95	23,00				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	7.862.130,87	8,68	0,00	3,27	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	7.862.130,87	8,68				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

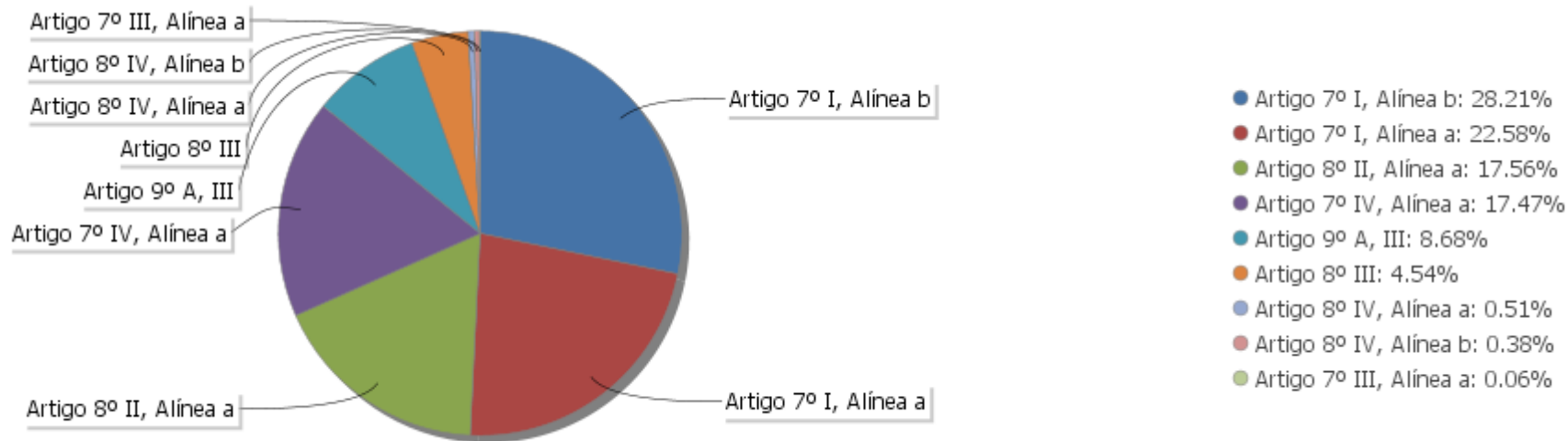
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,49 165,33	1,76 261,51	3,08 293,36	4,80 200,57	9,79 175,58	100.489,30	361.953,73
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,57 195,26	0,97 145,08	2,68 255,57	6,19 258,98	14,55 261,05	147.715,27	247.910,41
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,44 148,23	0,67 99,17	2,67 254,69	6,36 266,11	17,53 314,53	248,35	378,94
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,43 145,73	0,67 99,06	1,08 103,13	3,31 138,56	10,59 189,96	65.225,74	99.581,94
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,01 1,79	1,48 140,94	4,98 208,17	13,86 248,68	0,00	89,87
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,03 0,40	-7,71 2,21	0,13 3,88	6,55 3,55	18,22 9,23	-1.427.882,46	-1.347.311,65
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-3,33 5,10	-3,33 6,59	-2,25 1,51	1,65 -1,36	6,63 -2,36	-141.855,49	-147.328,98
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,92 7,51	-2,01 7,91	7,51 11,26	3,96 0,95	-2,06 -11,05	-4.320,32	-9.559,30
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,91 7,52	-0,34 9,58	-1,28 2,47	-1,48 -4,49	-11,64 -20,63	-3.148,78	-1.181,62
Artigo 9º A, III % do CDI	-5,47 -1.862,03	0,89 132,26	-0,70 -66,50	9,52 397,86	27,62 495,52	-496.108,54	-81.148,50
						-1.759.636,93	-876.615,16

Análise de Liquidez

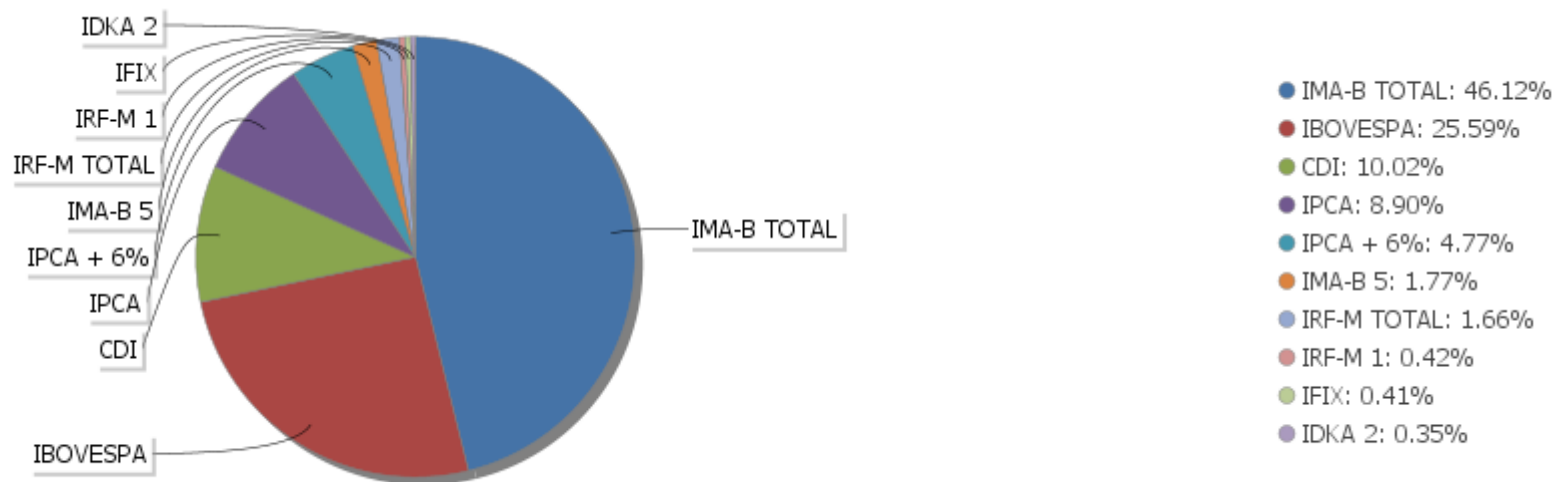
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	48.544.442,89	53,58	48.544.442,89	53,58
de 31 a 364 dias	15.278.591,51	16,86	63.823.034,40	70,45
acima de 365 dias	26.770.617,14	29,55	90.593.651,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

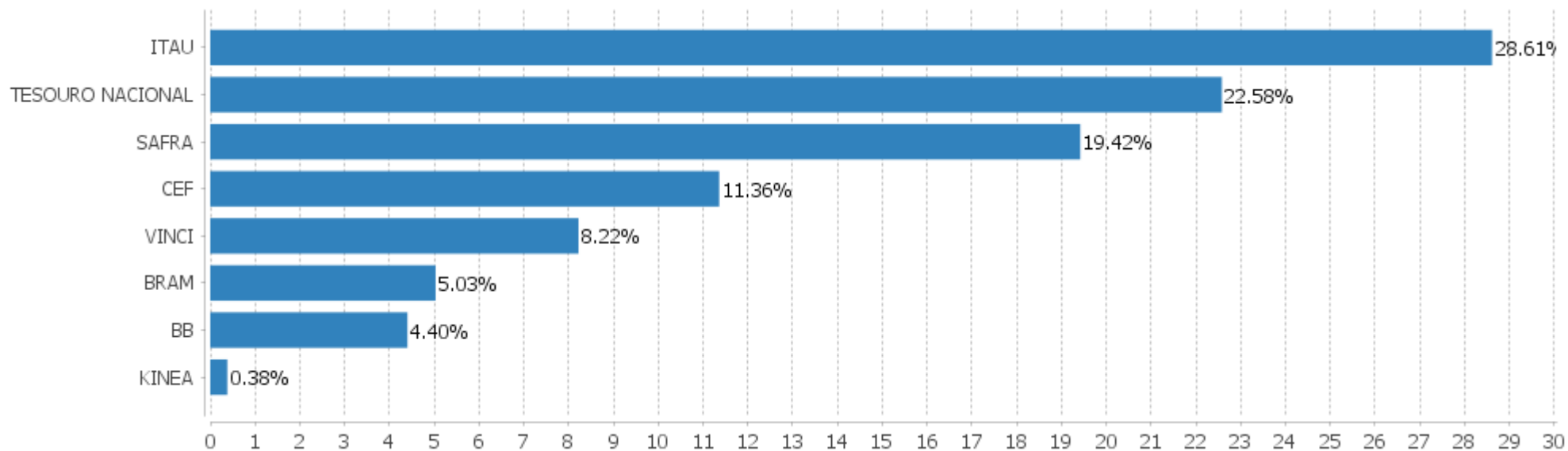


Alocação Por Estratégia



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	0,99	-1,89											-0,92
IPCA + 5,5%	0,68	0,63											1,32
p.p. indexador	0,31	-2,53											-2,24
2019	3,15	0,30	0,52	1,27	1,20	2,42	1,40	0,52	1,52	1,46	0,53	2,59	18,22
IPCA + 5,5%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	2,36	-0,56	-0,63	0,25	0,60	2,01	0,72	-0,06	1,12	0,87	-0,41	0,99	8,15

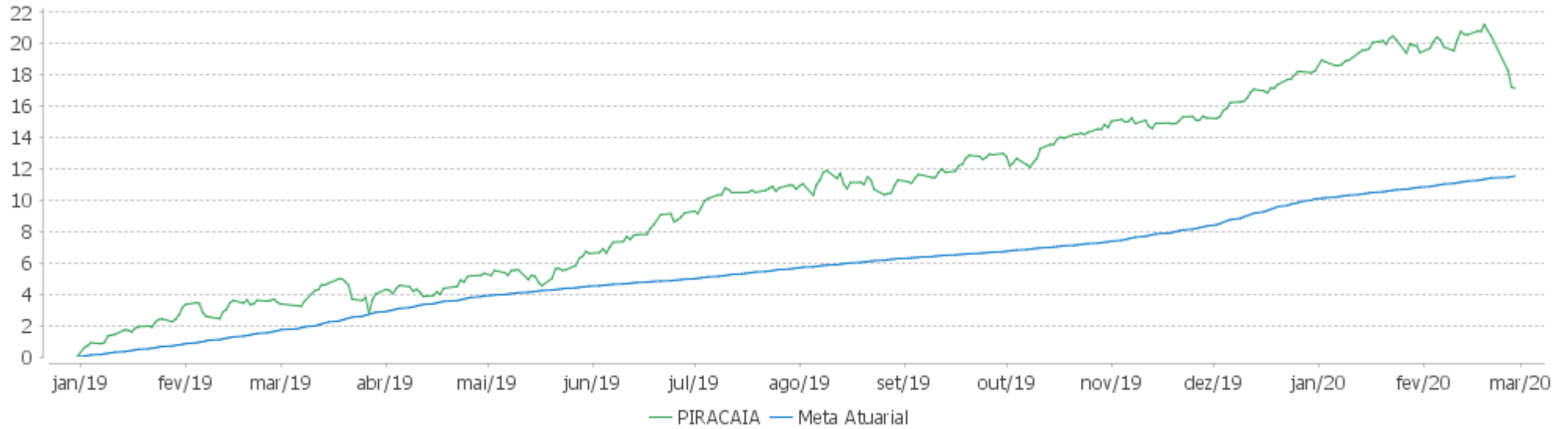
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

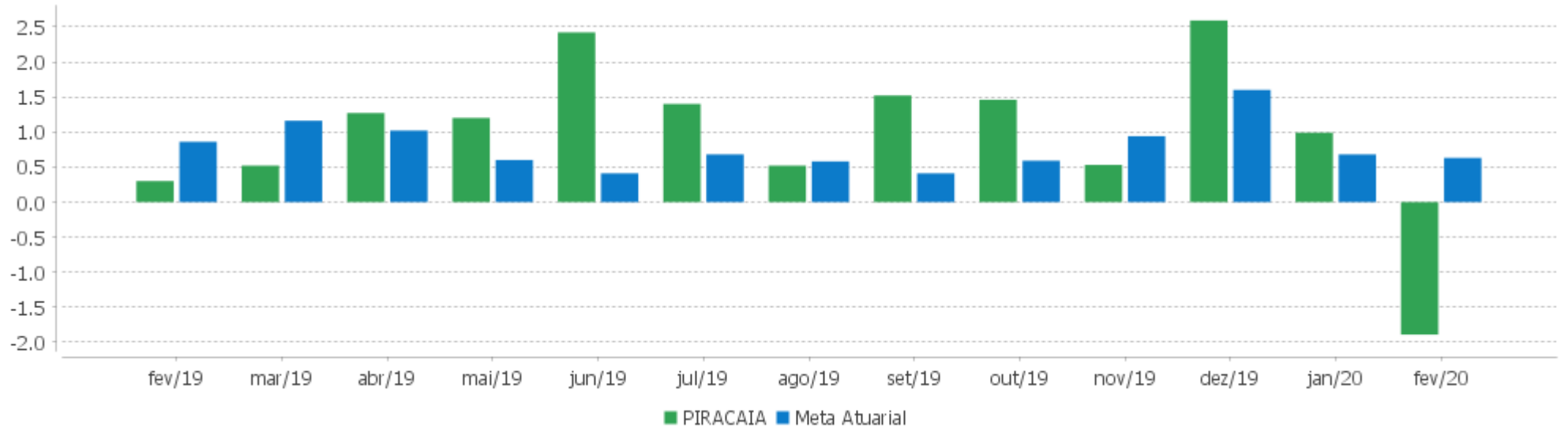
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	9	64,29	03 meses	1,65	2,94	-1,29	5,86
Meses abaixo da Meta Atuarial	5	35,71	06 meses	5,27	4,95	0,32	4,68
			12 meses	13,21	9,70	3,51	4,66
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,15	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,89	2020-02	Desde 31/12/2018	17,13	11,52	5,61	4,51

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
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,59 199,82	0,75 111,12	1,21 115,43	3,86 161,44	10,56 189,41		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,26 0,01	0,60 0,14	0,95 -0,67	2,60 0,40	9,60 5,60	19,17 11,12	31,31 20,19
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,67 -0,05	2,67 -0,06	6,36 -0,18	17,53 -0,47	33,98 -0,67	47,95 -1,32
NTN-B 150826 (5,510000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 0,04	1,76 1,04	3,08 0,34	4,80 -1,75	9,79 -8,21		
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,69 -0,03	2,69 -0,04	6,35 -0,19	17,63 -0,37	34,00 -0,65	48,25 -1,02
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,18 -0,03	2,40 -0,05	5,51 -0,15	11,87 -0,29	22,95 -0,54	37,12 -0,84
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,17 -0,03	2,40 -0,05	5,56 -0,10	11,93 -0,24	22,72 -0,77	36,55 -1,41
ITAU RENDA FIXA PRE FIXADO LP FICFI Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,49 -0,04	2,11 -0,06	4,79 -0,12	11,60 -0,26	22,15 -0,84	37,51 -1,55
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,25	1,51 0,80	3,02 0,29	6,73 0,19	16,03 -1,97	25,37 -9,28	32,93 -16,34
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,60 -0,08	1,06 -0,16	2,17 -0,27	4,96 -0,41	10,35 -0,84	20,98 -1,54	34,79 -2,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,36 -0,02	0,79 -0,04	1,19 -0,05	2,77 -0,11	6,31 -0,21	13,44 -0,41	24,42 -0,64
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,62 0,18	0,95 0,24	3,19 0,46	7,16 0,62	18,17 0,17	37,39 2,74	51,91 2,65
BB PREV IPCA III Var. IPCA + 6% p.p.	0,55 -0,12	0,97 -0,42	2,08 -0,98	5,04 -0,15	11,35 1,13	31,95 10,57	44,28 12,05
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,02	0,66 -0,05	2,66 -0,07	6,38 -0,16	17,61 -0,39	33,72 -0,93	47,55 -1,72
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT Var. IBOVESPA p.p.	0,27 8,70	0,58 10,51	0,91 4,67	2,99 -0,01	7,33 -1,66		
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME Var. IBOVESPA p.p.	-7,44 0,99	-7,10 2,82	-4,66 -0,90	3,24 0,24	10,24 1,26	17,08 -4,97	45,10 -11,17
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	-0,92	-2,01	7,51	3,96	38,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	7,51	7,91	11,26	0,95	29,75		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-8,60 -0,17	-8,14 1,78	3,39 7,14	12,78 9,78	32,42 23,44	43,20 21,15	89,76 33,49
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-5,42 3,01	-3,77 6,15	8,11 11,86	16,15 13,14	30,01 21,02	53,28 31,23	104,24 47,98
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-9,27 -0,84	-7,93 1,99	1,46 5,21	4,94 1,94	20,69 11,71	47,79 25,75	88,59 32,32
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,96 2,47	-5,59 4,33	1,68 5,43	8,02 5,02	16,91 7,92	37,95 15,91	77,13 20,86
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI Var. IBOVESPA p.p.	-7,81 0,62	-8,75 1,17	-1,77 1,99	5,16 2,16	12,80 3,81	29,32 7,27	64,38 8,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-9,79	-9,96	-2,64	5,05	20,11	42,38	
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,96 2,47	-3,79 6,14	4,90 8,65	12,61 9,61	27,42 18,43	49,08 27,03	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII Var. IFIX p.p.	-0,91 2,78	-0,34 6,97	-1,28 -3,82	-7,78 -19,34	-21,41 -43,15	-49,51 -77,73	320,75 274,66
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-5,69 2,74	0,46 10,38	-1,30 2,45	8,85 5,84	26,84 17,86	48,66 26,61	81,60 25,33
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-5,24 3,19	1,37 11,29	0,13 3,88	6,50 3,50	29,59 20,60		
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

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	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
Renda Variável							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00		0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,54	6,84	14,98	14,49
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54
IPCA + 5,5%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 4%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

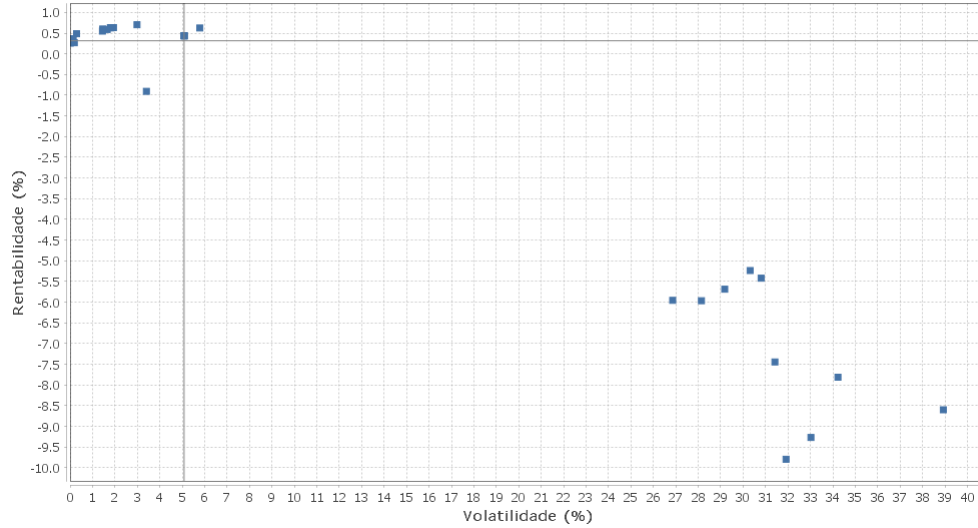
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
03/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	378.000,00	21.493,12269000	17,5870210000
03/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	48.000,00	2.729,28543000	17,5870210000
06/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	37.000,00	2.102,85890000	17,5950940000
10/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	1.000.000,00	56.817,56321000	17,6001916222
10/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	0,00	1.000.000,00	34.441,19531000	29,0349969273
11/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	328.500,00	0,00	18.661,89710000	17,6027120000
12/02/2020	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	1.000.000,00	0,00	129.641,08101830	7,7136043000
12/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	65.125,00	0,00	3.699,18674000	17,6052210000
12/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.014.160,00	0,00	57.605,63870000	17,6052210000
12/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	132.012,65	0,00	7.498,49434000	17,6052210000
12/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	0,00	1.000.000,00	32.986,39225000	30,3155310960
17/02/2020	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	1.000.000,00	0,00	338.445,78250860	2,9546830000
17/02/2020	BB PREV IPCA III	0,00	103.605,91	47.523,37447400	2,1801042360
20/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	21.362,69	0,00	1.212,40989000	17,6200230000
21/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	140.000,00	0,00	7.944,45645000	17,6223510000
21/02/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	383.852,43	0,00	100.396,35975592	3,8233700000
21/02/2020	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	383.850,00	0,00	841,85390100	455,9579750000
27/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	122.341,00	0,00	6.940,47095000	17,6271900000
27/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	112.972,14	0,00	6.408,97046000	17,6271900000
28/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	158.081,55	0,00	8.966,82670000	17,6295980000
28/02/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	269.409,60	0,00	15.281,66440000	17,6295980000

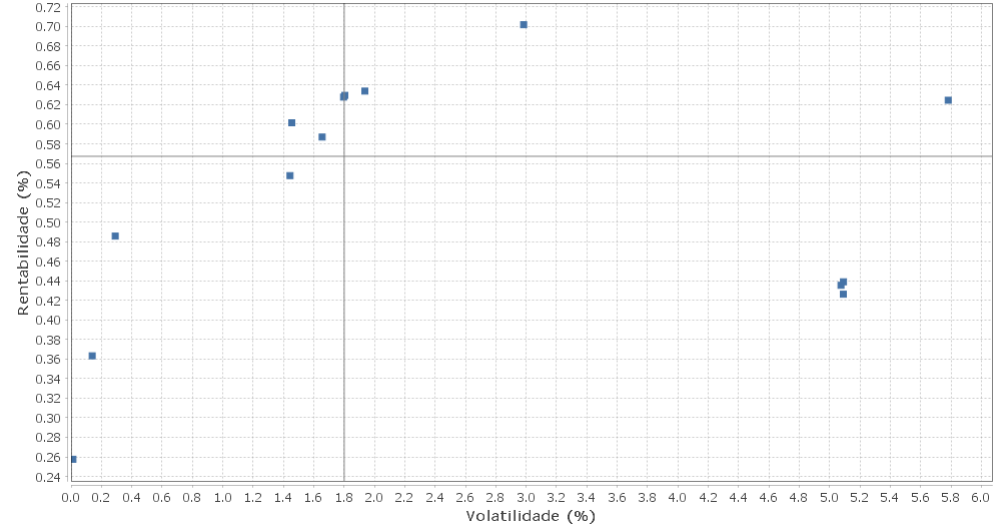
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

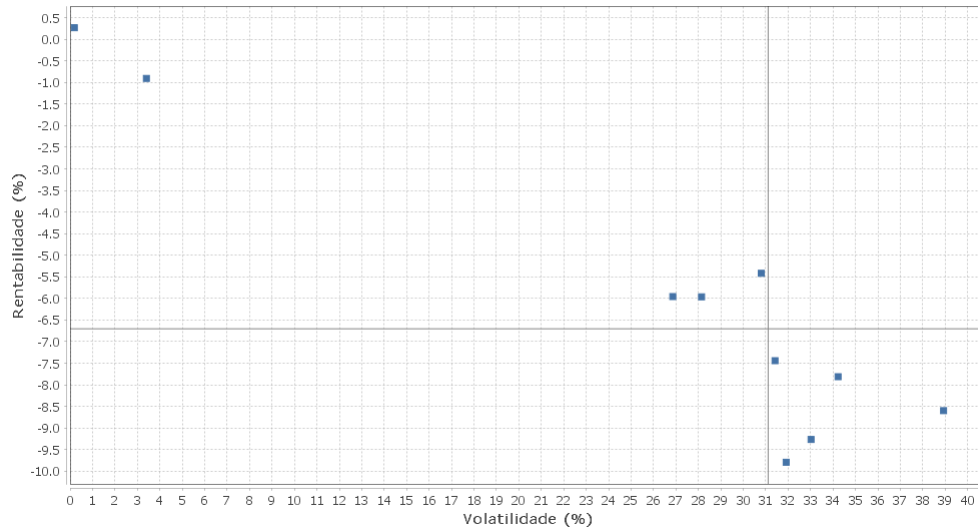
PIRACAIA - No Mês



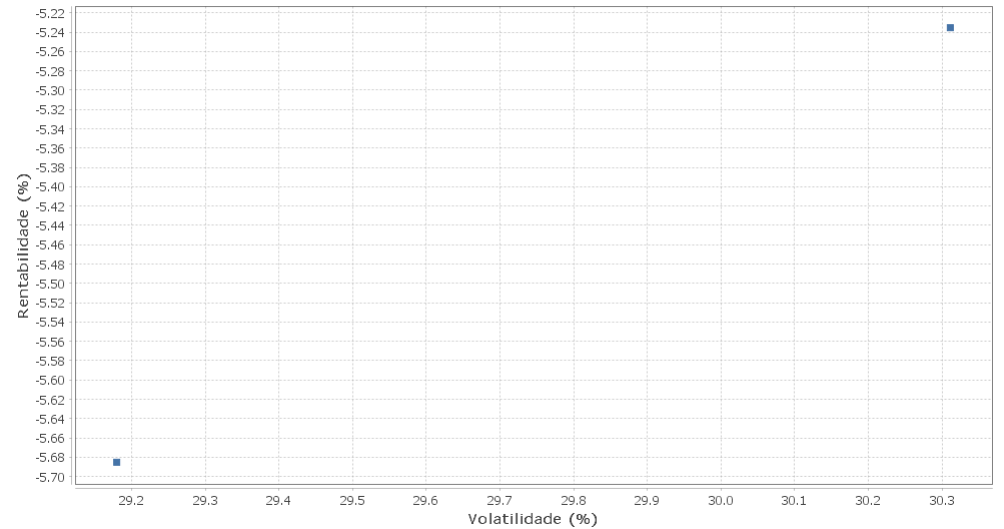
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,26	7.444.593,04	8,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,36	353.653,32	0,39
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	Artigo 8º III	0,19	0,03	0,27	2.277.487,24	2,51
NTN-B 150826 (5,510000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,49	20.457.267,18	22,58
BB PREV IPCA III	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	0,18	0,55	3.985.706,22	4,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,46	0,18	0,60	294.350,54	0,32
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,66	0,20	0,59	8.380.993,15	9,25
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	74.102,15	0,08
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	1.400.922,17	1,55
ITAU RENDA FIXA PRE FIXADO LP FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	0,24	0,63	1.384.507,43	1,53
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	2,98	0,35	0,70	1.518.179,00	1,68
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	Artigo 8º IV, Alínea b	3,40	0,30	-0,91	344.566,63	0,38
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,07	0,55	0,44	57.289,15	0,06
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,43	4.554.391,30	5,03
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,44	3.521,87	0,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	5,78	0,63	0,62	11.984.634,20	13,23
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,86	2,44	-5,96	5.134.836,03	5,67
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,14	2,57	-5,96	926.021,44	1,02
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	29,18	2,70	-5,69	4.090.651,48	4,52
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	30,31	2,84	-5,24	3.771.479,39	4,16
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	30,80	2,88	-5,42	920.010,21	1,02
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	Artigo 8º III	31,42	2,83	-7,44	1.839.278,12	2,03
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	31,91	2,73	-9,79	6.946.258,03	7,67
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	33,02	2,88	-9,27	1.637.951,96	1,81
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	Artigo 8º II, Alínea a	34,23	3,09	-7,81	50.948,47	0,06
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	38,92	3,53	-8,60	295.153,71	0,33