



LDB
EMPRESAS

PIRACAIA
MARÇO 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 28.04.2020.

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 72,03%

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	0,72	2,49	20.604.517,51	24,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,72	2,49	20.604.517,51	24,23

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	4,55	-1,71	-0,56	427.734,44	0,50	1.560.138.713,72	0,03
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA PRE FIXADO LP FICFI	5,01	-0,13	1,36	1.382.675,86	1,63	175.607.213,67	0,79
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12,57	-6,73	-5,84	11.178.027,91	13,14	1.204.323.174,71	0,93
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	11,10	-7,01	-6,39	4.235.212,46	4,98	708.758.244,80	0,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	3.271,74	0,00	5.890.819.394,91	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,44	0,59	1,38	355.732,12	0,42	10.517.651.272,61	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	1.375.745,85	1,62	9.363.308.744,85	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,65	-1,45	-0,41	290.071,60	0,34	8.199.299.170,30	0,00
BB	BB	BB PREV IPCA III	3,85	-1,71	-0,75	3.917.743,91	4,61	865.069.606,77	0,45
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS	7,84	-2,69	-1,23	1.477.300,00	1,74	1.360.035.773,21	0,11
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,11	-4,91	-3,98	24.643.515,89	28,98		

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	11,08	-7,00	-6,38	53.279,02	0,06	2.791.754.446,71	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			11,08	-7,00	-6,38	53.279,02	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	1,32	0,53	1,13	7.284.223,66	8,57	5.019.962.419,71	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,36	3,47	4,24	8.672.011,00	10,20	821.904.874,24	1,06
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,67	2,12	2,80	15.956.234,66	18,76		
Renda Fixa			3,65	-1,30	-0,14	61.257.547,08	72,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,42%

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	41,09	-30,85	-36,90	35.231,14	0,04	41.494.924,62	0,08
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	43,23	-35,06	-40,34	191.678,66	0,23	894.019.781,17	0,02
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	35,16	-25,42	-29,59	3.829.429,72	4,50	312.668.247,70	1,22
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	38,94	-32,44	-39,18	4.692.569,48	5,52	2.717.755.336,40	0,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	46,64	-41,88	-46,49	951.921,27	1,12	1.314.153.409,58	0,07
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	38,08	-31,73	-37,19	628.078,72	0,74	1.183.063.999,73	0,05
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	33,40	-28,04	-33,37	666.341,23	0,78	147.373.614,90	0,45
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			37,91	-30,90	-36,22	10.995.250,22	12,93		

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	28,59	-14,56	-20,62	1.571.551,27	1,85	330.179.248,95	0,48
CEF	CEF	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	1,84	0,57	1,16	2.290.521,27	2,69	504.709.364,08	0,45
Sub-total Artigo 8º III			11,76	-6,19	-9,31	3.862.072,54	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	11,23	-1,13	-3,12	459.667,18	0,54	49.572.194,84	0,93
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			11,23	-1,13	-3,12	459.667,18	0,54		

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	25,47	1,65	1,30	350.239,44	0,41	84.665.330,25	0,41
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			25,47	1,65	1,30	350.239,44	0,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	29,94	-24,81	-29,80	15.667.229,38	18,42
---	-------	--------	--------	---------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,55%

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 NIVEL I	23,76	6,30	6,80	4.348.520,89	5,11	876.229.505,18	0,50
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	26,85	0,01	1,37	3.771.670,20	4,43	809.917.545,69	0,47
Sub-total Artigo 9º A, III			25,36	3,28	4,20	8.120.191,09	9,55		
Investimentos no Exterior			25,36	3,28	4,20	8.120.191,09	9,55		
Total						85.044.967,55	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	20.604.517,51	24,23	0,00	23,47	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.643.515,89	28,98	0,00	32,23	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	53.279,02	0,06	0,00	0,07	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	15.956.234,66	18,76	0,00	15,70	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	61.257.547,08	72,03				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	10.995.250,22	12,93	0,00	18,32	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.862.072,54	4,54	0,00	4,49	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	459.667,18	0,54	0,00	0,51	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	350.239,44	0,41	0,00	0,40	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	15.667.229,38	18,42				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.120.191,09	9,55	0,00	3,27	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.120.191,09	9,55				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

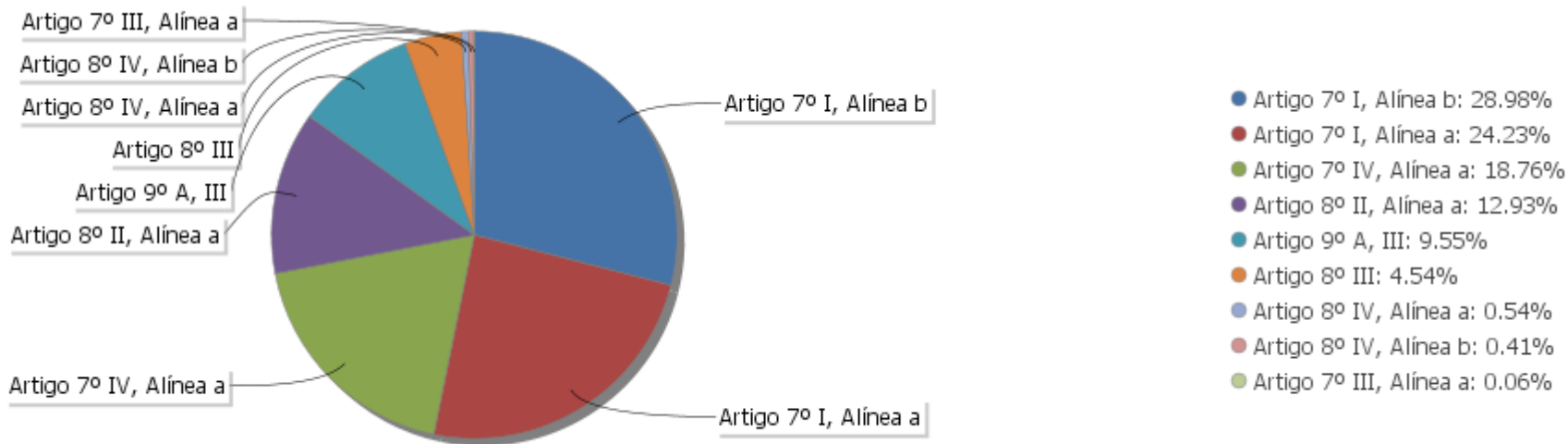
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,72 212,72	2,49 245,86	2,49 245,86	5,02 221,66	9,54 175,53	147.250,33	509.204,06
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-4,91 -1.450,54	-3,98 -393,42	-3,98 -393,42	-1,33 -58,68	8,29 152,44	-1.273.452,31	-1.025.541,90
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-7,00 -2.068,69	-6,38 -630,43	-6,38 -630,43	-3,82 -168,66	8,70 159,95	-4.010,13	-3.631,19
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,12 625,80	2,80 276,33	2,80 276,33	4,80 212,02	12,49 229,74	329.331,72	428.913,66
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,01 1,18	0,01 1,18	2,65 117,19	12,83 235,95	0,00	89,87
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,90 -0,99	-36,22 0,63	-36,22 0,63	-28,00 2,29	-17,68 5,79	-4.915.929,63	-6.263.241,28
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-6,19 23,72	-9,31 27,55	-9,31 27,55	-5,82 24,47	-0,82 22,65	-254.692,82	-402.021,80
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,13 28,78	-3,12 33,74	-3,12 33,74	3,90 34,19	0,60 24,07	-5.230,93	-14.790,23
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,65 31,55	1,30 38,16	1,30 38,16	4,71 35,00	-10,73 12,74	5.672,81	4.491,19
Artigo 9º A, III % do CDI	3,28 970,04	4,20 414,93	4,20 414,93	10,18 449,59	24,21 445,31	258.060,22	176.911,72
						-5.713.000,74	-6.589.615,90

Análise de Liquidez

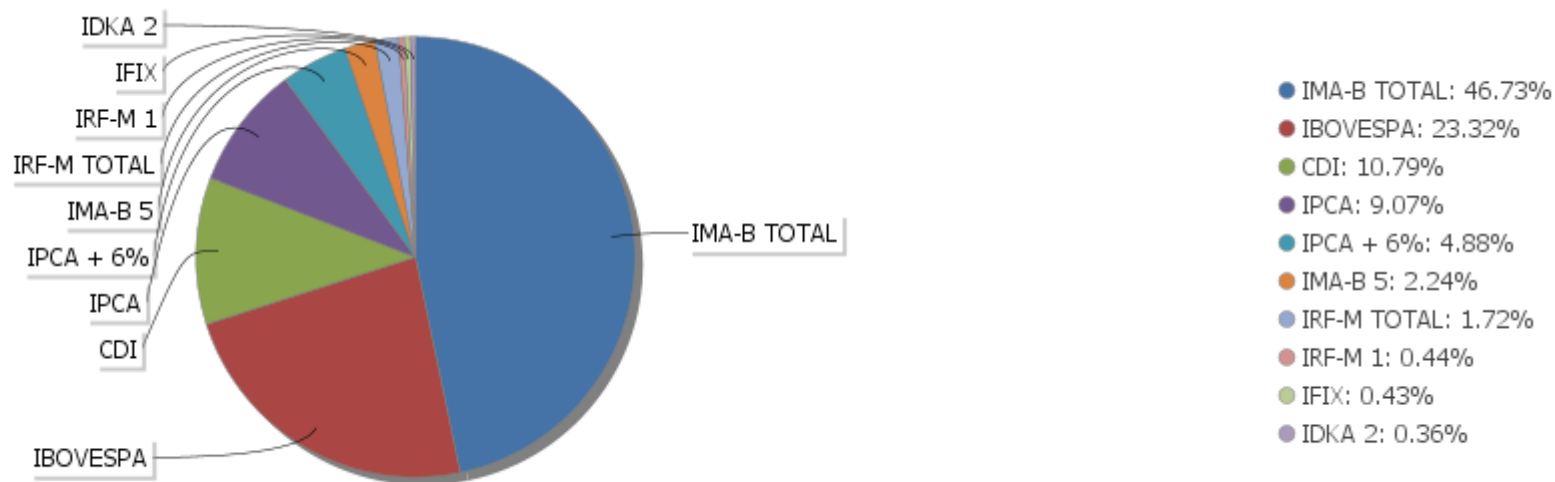
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	46.794.900,32	55,02	46.794.900,32	55,02
de 31 a 364 dias	11.440.599,19	13,45	58.235.499,51	68,48
acima de 365 dias	26.809.468,04	31,52	85.044.967,55	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

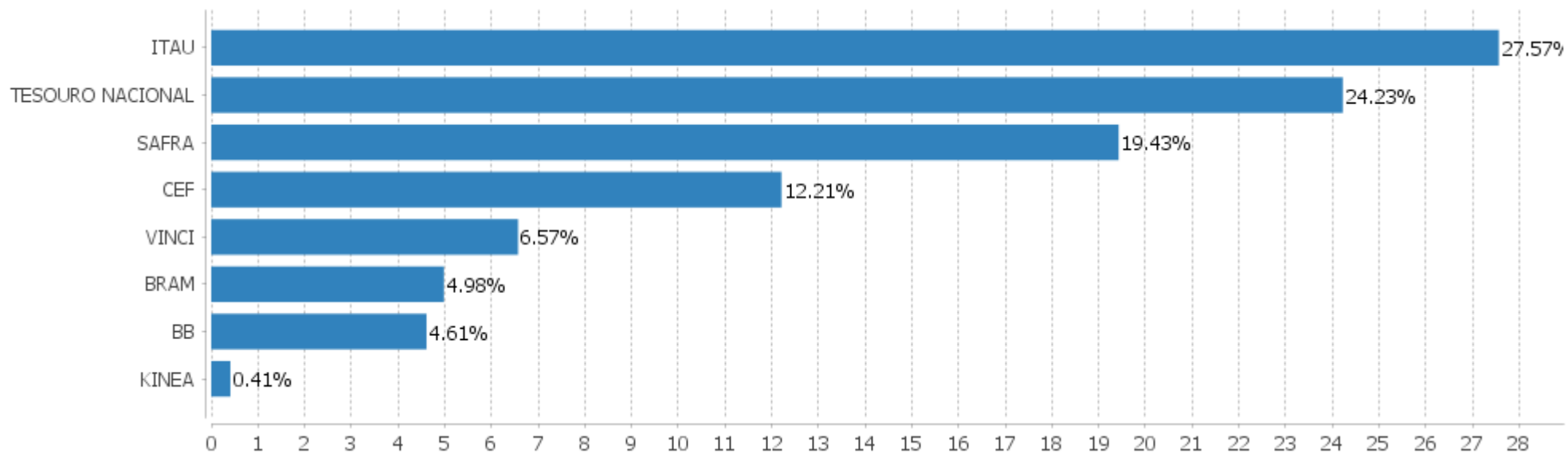


Alocação Por Estratégia



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	-6,31										-7,18
IPCA + 5,5%	0,68	0,63	0,54										1,86
p.p. indexador	0,31	-2,53	-6,85										-9,04
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

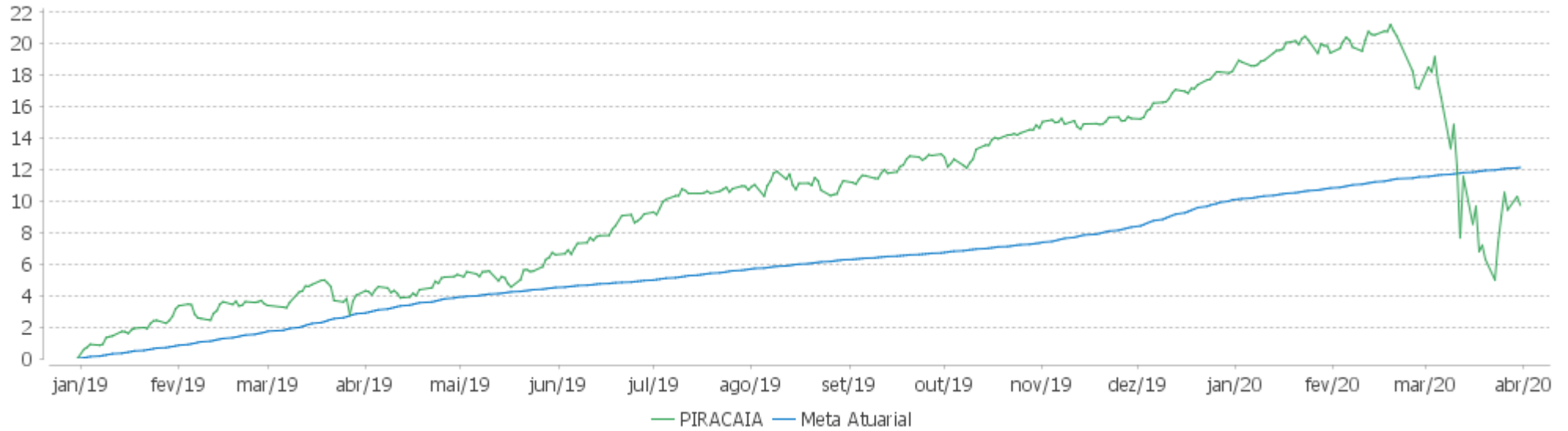
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

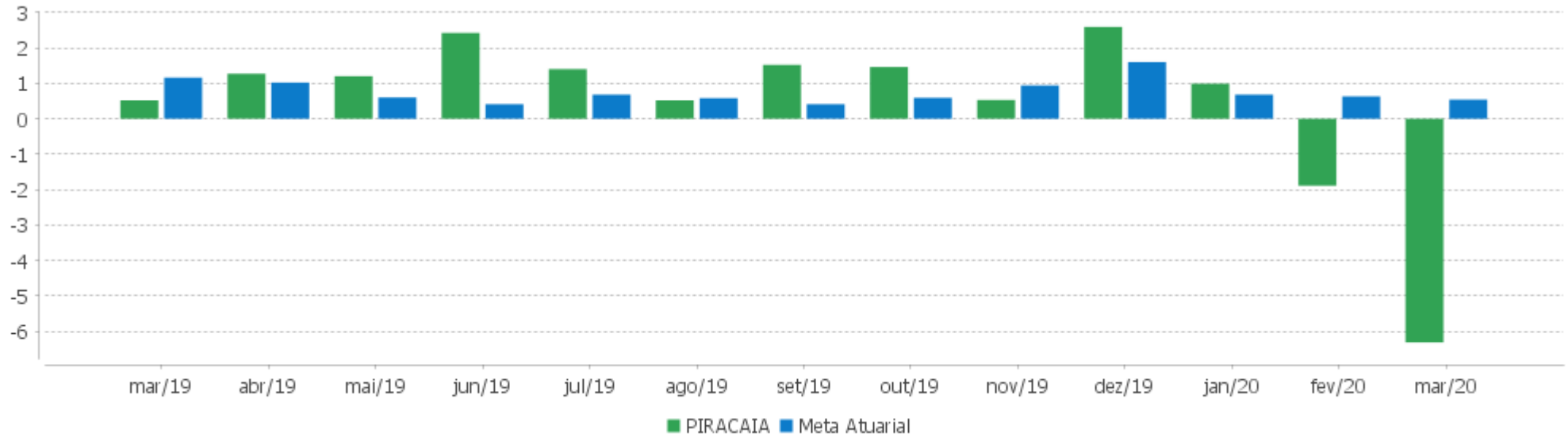
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	9	60,00	03 meses	-7,18	1,86	-9,04	18,69
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	40,00	06 meses	-2,86	5,08	-7,94	13,34
			12 meses	5,51	9,03	-3,52	9,81
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,15	2019-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,31	2020-03	Desde 31/12/2018	9,73	12,12	-2,38	9,05

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
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	-1,71 0,04	-0,56 0,01	-0,56 0,01	1,99 -0,03	9,18 -0,15	18,74 -0,65	32,42 -1,25
ITAU RENDA FIXA PRE FIXADO LP FICFI Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,13 -0,03	1,36 -0,06	1,36 -0,06	3,19 -0,12	10,84 -0,26	20,44 -0,81	35,35 -1,50
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,69 4,28	-1,23 5,08	-1,23 5,08	1,63 5,27	11,89 2,75	19,38 -4,72	27,84 -9,59
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,45 -0,24	-0,41 -0,41	-0,41 -0,41	1,98 -0,48	8,03 -1,08	17,44 -1,70	30,97 -2,96
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,73 0,24	-5,84 0,47	-5,84 0,47	-2,91 0,73	9,71 0,57	26,82 2,72	39,96 2,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
BB PREV IPCA III Var. IPCA + 6% p.p.	-1,71 -2,29	-0,75 -2,73	-0,75 -2,73	1,75 -3,58	8,65 -0,90	28,74 7,36	40,59 8,63
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,01 -0,04	-6,39 -0,08	-6,39 -0,08	-3,80 -0,15	8,76 -0,38	23,20 -0,90	35,83 -1,60
NTN-B 150826 (5,510000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,72 7,69	2,49 8,80	2,49 8,80	5,02 8,66	9,54 0,40		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,53 0,46	1,13 0,60	1,13 0,60	2,34 0,03	9,75 6,45	18,58 10,56	30,29 19,37
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	3,47 1.026,20	4,24 419,36	4,24 419,36	6,85 302,74	13,21 243,01		
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,00 -0,03	-6,38 -0,07	-6,38 -0,07	-3,82 -0,18	8,70 -0,44	23,48 -0,62	36,30 -1,12
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A Var. IBOVESPA p.p.	-1,13 28,78	-3,12 33,74	-3,12 33,74	3,90 34,19	6,01 29,48		
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT Var. IBOVESPA p.p.	0,57 30,48	1,16 38,02	1,16 38,02	2,71 33,00	7,54 31,01		
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	-14,56	-20,62	-20,62	-13,66	-7,63	2,85	22,88

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.	15,35	16,24	16,24	16,62	15,84	17,31	10,52
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	-35,06	-40,34	-40,34	-28,21	-13,79	-6,52	25,26
Var. IBOVESPA p.p.	-5,15	-3,49	-3,49	2,08	9,68	7,94	12,89
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-41,88	-46,49	-46,49	-38,72	-29,21	-15,65	11,25
Var. IBOVESPA p.p.	-11,98	-9,64	-9,64	-8,43	-5,74	-1,19	-1,12
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	-31,73	-34,30	-34,30	-22,13	-9,71	2,06	41,28
Var. IBOVESPA p.p.	-1,83	2,55	2,55	8,16	13,76	16,52	28,92
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	-25,42	-29,59	-29,59	-21,42	-12,24	2,62	32,87
Var. IBOVESPA p.p.	4,48	7,27	7,27	8,86	11,23	17,08	20,51
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	-30,85	-36,90	-36,90	-29,44	-21,84	-10,12	16,33
Var. IBOVESPA p.p.	-0,95	-0,04	-0,04	0,84	1,63	4,35	3,96
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-32,44	-39,18	-39,18	-31,38	-17,47	-4,42	
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	-28,04	-30,77	-30,77	-20,58	-8,22	7,77	
Var. IBOVESPA p.p.	1,86	6,09	6,09	9,71	15,25	22,23	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	1,65	1,30	1,30	-1,98	-19,23	-46,75	325,44
Var. IFIX p.p.	17,49	23,30	23,30	5,10	-19,68	-52,54	302,75
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	6,30	6,80	6,80	12,71	27,06	62,46	91,78
Var. IBOVESPA p.p.	36,21	43,65	43,65	43,00	50,53	76,92	79,42
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	0,01	1,37	1,37	5,85	21,73		
Var. IBOVESPA p.p.	29,91	38,23	38,23	36,14	45,20		
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

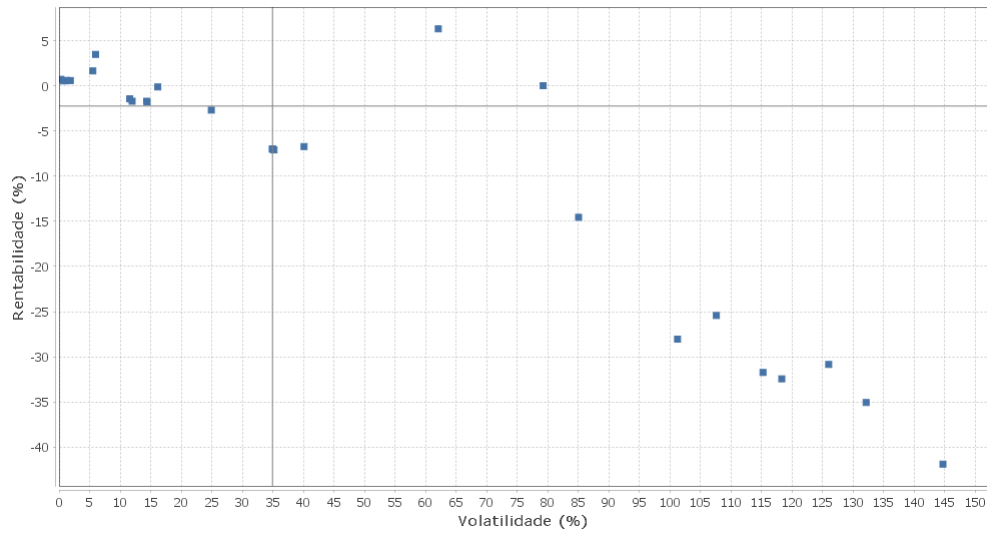
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	418.000,00	23.706,73924181	17,6321170000
02/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	131.782,94	0,00	7.474,02821794	17,6321170000
02/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	60.000,00	3.402,88123088	17,6321170000
03/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	11.770,00	667,43942959	17,6345590000
06/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	363.000,00	0,00	10.970,34350473	33,0892100000
12/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	142.118,99	0,00	8.051,03698059	17,6522590000
12/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	278.211,00	0,00	15.760,64570546	17,6522590000
18/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	325.000,00	18.400,53387592	17,6625310000
20/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	42.416,35	0,00	2.401,63626540	17,6614380000
20/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	21.557,47	0,00	1.220,59540112	17,6614380000

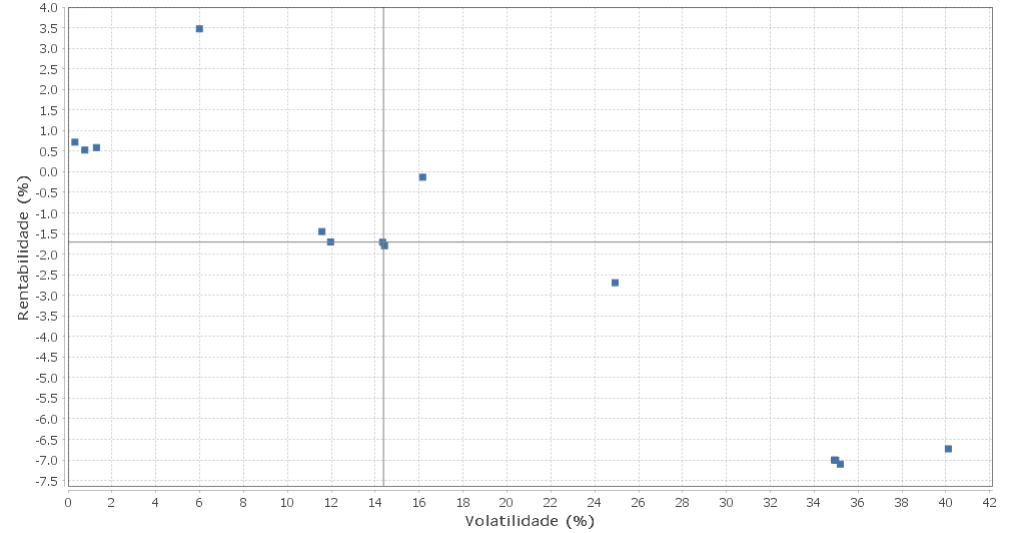
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

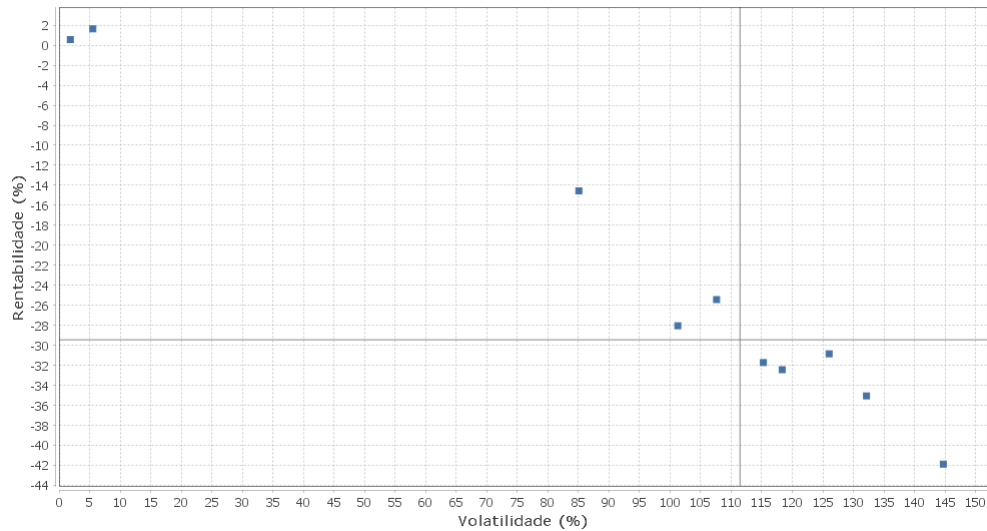
PIRACAIA - No Mês



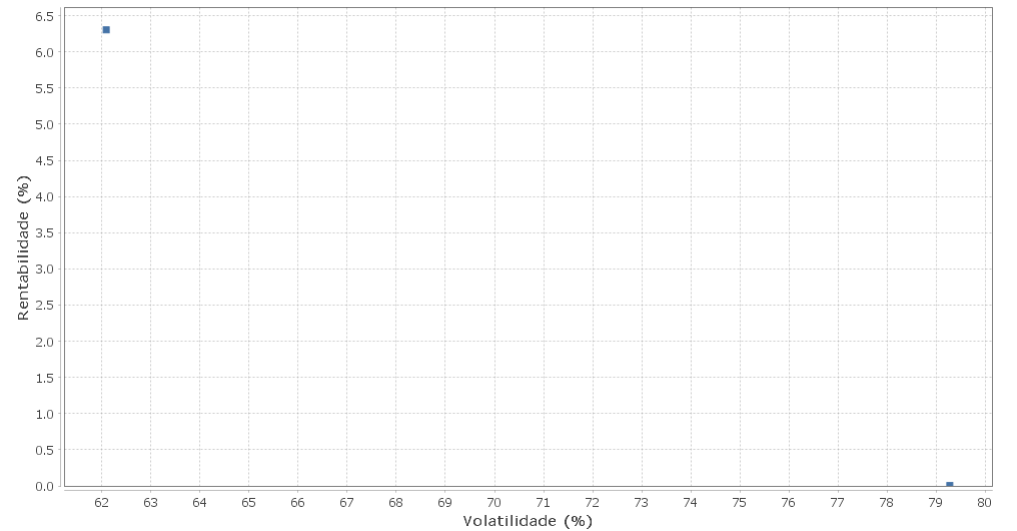
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,510000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,32	0,07	0,72	20.604.517,51	24,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	0,10	0,53	7.284.223,66	8,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,59	355.732,12	0,42
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	Artigo 8º III	1,84	0,22	0,57	2.290.521,27	2,69
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	Artigo 8º IV, Alínea b	5,53	0,65	1,65	350.239,44	0,41
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	5,99	0,78	3,47	8.672.011,00	10,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,13	-1,45	290.071,60	0,34
BB PREV IPCA III	Artigo 7º I, Alínea b	11,96	1,16	-1,71	3.917.743,91	4,61
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	14,33	1,41	-1,71	427.734,44	0,50
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	1.375.745,85	1,62
ITAU RENDA FIXA PRE FIXADO LP FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	16,16	1,67	-0,13	1.382.675,86	1,63
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	24,93	2,46	-2,69	1.477.300,00	1,74
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	34,92	3,29	-7,00	53.279,02	0,06
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	Artigo 7º I, Alínea b	34,98	3,29	-7,01	4.235.212,46	4,98
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	3.271,74	0,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	40,11	3,84	-6,73	11.178.027,91	13,14
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Artigo 9º A, III	62,09	6,71	6,30	4.348.520,89	5,11
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	79,27	8,21	0,01	3.771.670,20	4,43
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	Artigo 8º III	85,06	8,10	-14,56	1.571.551,27	1,85
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	101,27	9,00	-28,04	666.341,23	0,78
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	107,62	9,82	-25,42	3.829.429,72	4,50
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	115,26	10,21	-31,73	628.078,72	0,74
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	118,33	10,48	-32,44	4.692.569,48	5,52
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	Artigo 8º II, Alínea a	126,02	11,38	-30,85	35.231,14	0,04
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	Artigo 8º II, Alínea a	132,15	11,73	-35,06	191.678,66	0,23
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	144,72	12,53	-41,88	951.921,27	1,12