



LDB
EMPRESAS

CANOINHAS
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 18.06.2020.

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

RENTA FIXA

79,48%

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-M1 | 0,45 | 0,60 | 1,38 | 2.685.550,25 | 7,89 | 6.969.533.398,64 | 0,04 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 11,10 | -6,98 | -6,33 | 5.234.155,21 | 15,38 | 5.743.378.118,49 | 0,09 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,44 | 0,59 | 1,38 | 355.225,48 | 1,04 | 10.517.651.272,61 | 0,00 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,75 | -1,97 | -1,06 | 919.656,47 | 2,70 | 1.326.400.859,08 | 0,07 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,58 | -1,80 | -0,64 | 4.654.237,31 | 13,68 | 9.363.308.744,85 | 0,05 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 3,65 | -1,45 | -0,41 | 1.674.381,47 | 4,92 | 8.199.299.170,30 | 0,02 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,02 | -0,11 | 1,36 | 4.296.818,89 | 12,63 | 15.907.113.181,36 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV ALOC FIC | 5,33 | -2,10 | -1,18 | 1.705.857,25 | 5,01 | 10.536.452.770,12 | 0,02 |
| CEF | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 5,32 | -0,13 | 1,31 | 3.464.071,87 | 10,18 | 11.020.077.699,37 | 0,03 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 9,95 | -2,02 | -0,98 | 24.989.954,20 | 73,44 | | |

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 |
|---|--------|---|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------|------------------|---------|
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,16 | -0,03 | 0,59 | 115.324,51 | 0,34 | 2.725.355.805,79 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,05 | 0,25 | 0,75 | 495.072,00 | 1,45 | 1.561.401.900,27 | 0,03 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,32 | 0,53 | 1,13 | 1.443.891,24 | 4,24 | 5.019.962.419,71 | 0,03 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,31 | 0,43 | 1,04 | 2.054.287,75 | 6,04 | | |

| | | | | | | | | | |
|-------------------|--|--|-------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|--|--|
| Renda Fixa | | | 9,33 | -1,87 | -0,87 | 27.044.241,95 | 79,48 | | |
|-------------------|--|--|-------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,52%

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 |
|---------------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|--------------|------------|----------------|---------|
| CEF | CEF | FIA BRASIL IBX-50 | 41,51 | -30,83 | -37,86 | 766.617,35 | 2,25 | 861.718.774,51 | 0,09 |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES | 40,32 | -29,71 | -36,62 | 779.646,43 | 2,29 | 477.022.607,99 | 0,16 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 77,27 | -30,27 | -37,24 | 1.546.263,78 | 4,54 | | |

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 |
|----------------------------------|-------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|--------------|------------|------------------|---------|
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | 34,39 | -27,59 | -32,65 | 430.574,71 | 1,27 | 220.127.415,20 | 0,20 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 41,94 | -31,71 | -37,40 | 798.108,33 | 2,35 | 1.382.617.129,81 | 0,06 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 41,23 | -30,69 | -36,11 | 415.383,55 | 1,22 | 777.057.191,68 | 0,05 |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT | 43,23 | -35,06 | -40,34 | 412.396,25 | 1,21 | 894.019.781,17 | 0,05 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 38,15 | -31,06 | -34,96 | 971.792,93 | 2,86 | 1.171.296.538,03 | 0,08 |
| MOAT | INTRAG | MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | 45,77 | -40,36 | -45,94 | 0,00 | 0,00 | 1.335.839.057,21 | 0,00 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 38,94 | -32,44 | -39,18 | 606.052,86 | 1,78 | 2.717.755.336,40 | 0,02 |
| MOAT | INTRAG | MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA | 101,35 | 6,48 | 6,48 | 1.374.795,82 | 4,04 | 686.931.355,96 | 0,20 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 77,35 | -33,05 | -38,25 | 5.009.104,45 | 14,72 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-------------|------------|------------------|---------|
| CEF | CEF | FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 7,25 | -5,31 | -6,10 | 426.757,53 | 1,25 | 4.401.772.920,54 | 0,01 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 7,25 | -5,31 | -6,10 | 426.757,53 | 1,25 | | |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

72,59

-30,49

-37,42

6.982.125,76

20,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

34.026.367,71

100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| | | | | Política de Investimentos | | | |
|---|---|---------------|------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 24.989.954,20 | 73,44 | 50,00 | 65,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 2.054.287,75 | 6,04 | 0,00 | 10,00 | 40,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 27.044.241,95 | 79,48 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alinea a | Fundos de Ações Referenciados | 1.546.263,78 | 4,54 | 0,00 | 7,00 | 30,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 5.009.104,45 | 14,72 | 0,00 | 11,00 | 20,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 426.757,53 | 1,25 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 6.982.125,76 | 20,52 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

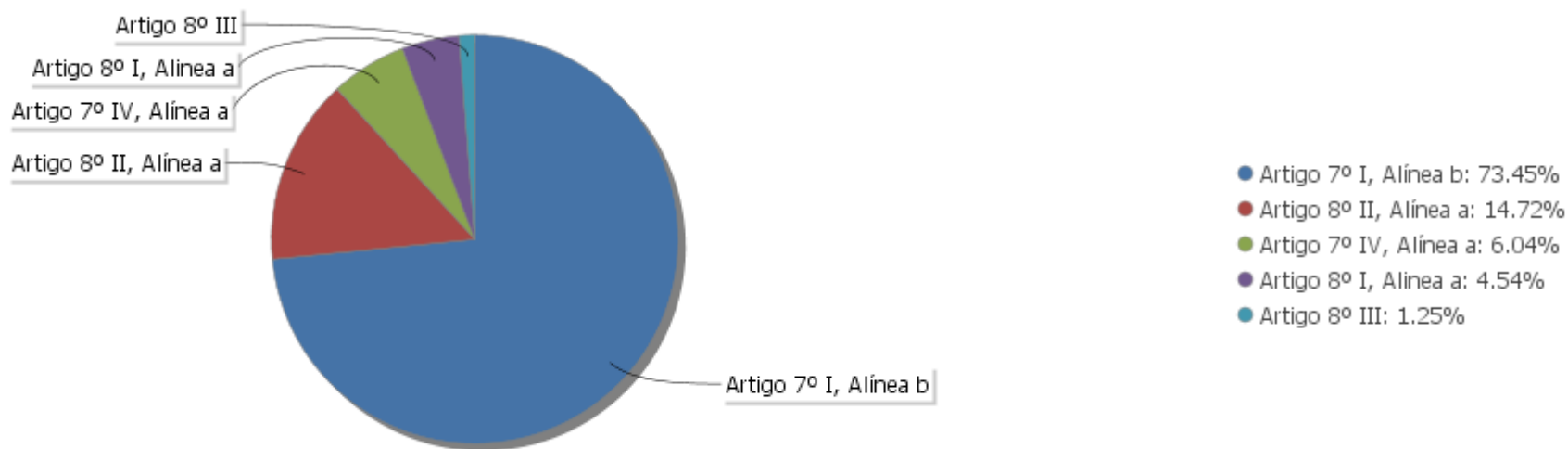
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|------------------|-----------------|-----------------|---------|----------|---------------|---------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | -2,02 -597,83 | -0,98 -96,80 | -0,98 -96,80 | | | -543.870,21 | -259.144,09 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,43 127,87 | 1,04 103,17 | 1,04 103,17 | | | 9.194,49 | 25.964,72 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -30,27 -0,37 | -37,24 -0,38 | -37,24 -0,38 | | | -446.924,45 | -623.775,60 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -33,05 -3,14 | -38,25 -1,40 | -38,25 -1,40 | | | -1.339.670,42 | -1.652.731,62 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | -5,31 24,59 | -6,10 30,76 | -6,10 30,76 | | | -23.940,30 | -27.740,45 |
| | | | | | | -2.345.210,89 | -2.537.427,04 |

Análise de Liquidez

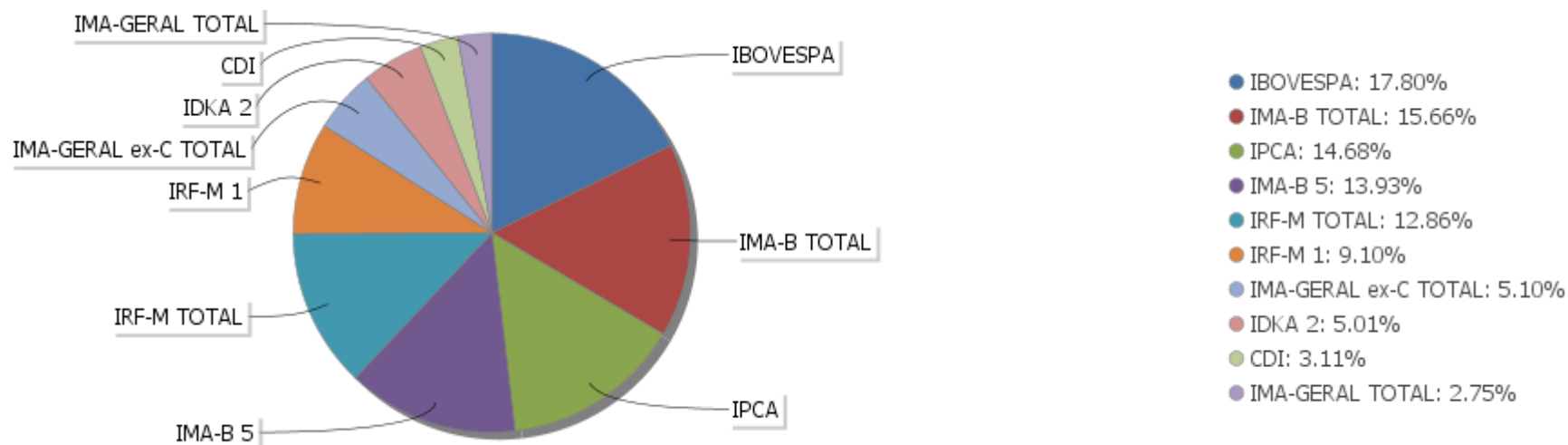
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 31.235.030,04 | 91,80 | 31.235.030,04 | 91,80 |
| de 31 a 364 dias | 2.791.337,67 | 8,20 | 34.026.367,71 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 34.026.367,71 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

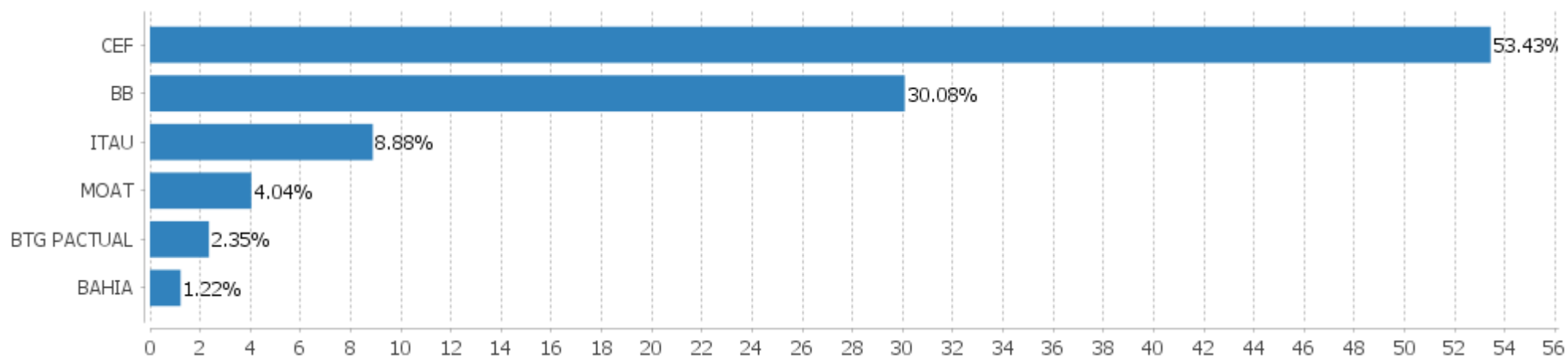


Alocação Por Estratégia



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 | 0,35 | -0,86 | -6,80 | | | | | | | | | | -7,28 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,67 | 0,58 | | | | | | | | | | 1,98 |
| p.p. indexador | -0,37 | -1,53 | -7,38 | | | | | | | | | | -9,26 |

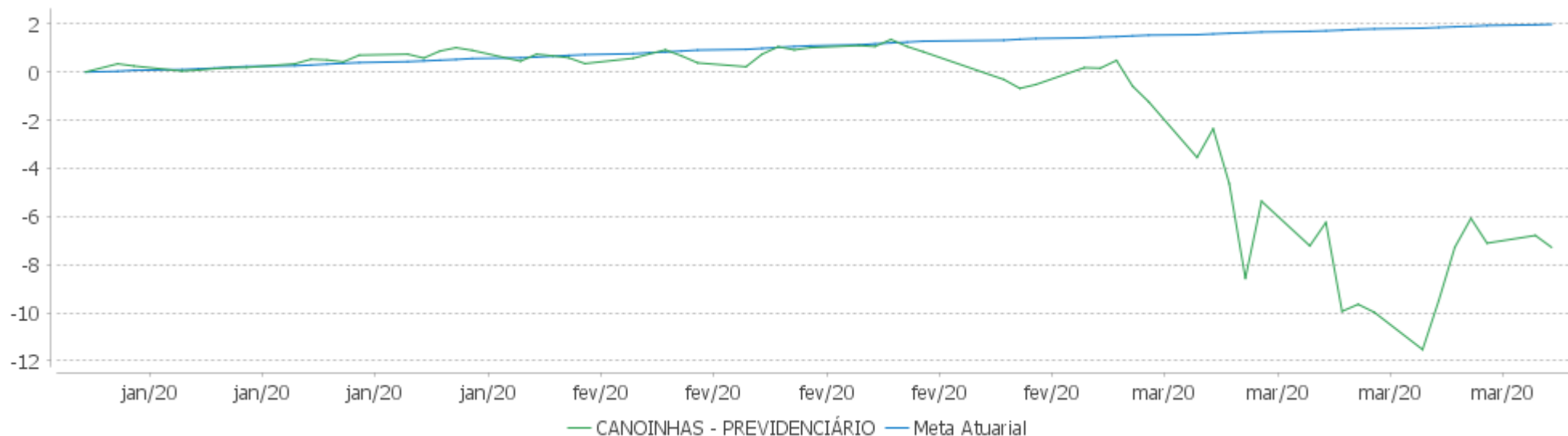
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 0 | 0,00 | 03 meses | -7,28 | 1,98 | -9,26 | 18,77 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 3 | 100,00 | 06 meses | | | | |
| | | | 12 meses | | | | |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 0,35 | 2020-01 | Desde 31/12/2019 | -7,28 | 1,98 | -9,26 | 18,77 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,80 | 2020-03 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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 PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | -0,03 -9,77 | 0,59 58,36 | 0,59 58,36 | 1,74 76,63 | 4,81 88,50 | 11,34 93,51 | 20,78 96,50 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 0,25 73,55 | 0,75 74,38 | 0,75 74,38 | 1,73 76,27 | 4,31 79,23 | 9,74 80,32 | 17,73 82,36 |
| 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 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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 |
| BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | -2,10 -0,17 | -1,18 -0,17 | -1,18 -0,17 | 0,61 -0,26 | 8,55 0,22 | 18,63 0,23 | 30,83 -0,39 |
| BB PREV RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p. | 0,60 -0,01 | 1,38 -0,06 | 1,38 -0,06 | 2,70 -0,13 | 6,40 -0,26 | 13,27 -0,53 | 23,59 -0,83 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | -0,13 -0,20 | 1,31 0,78 | 1,31 0,78 | 3,13 0,82 | 13,46 10,16 | 23,65 15,62 | 35,73 24,81 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS 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 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | -6,98 -0,01 | -6,33 -0,02 | -6,33 -0,02 | -3,73 -0,09 | 8,93 -0,22 | 23,52 -0,58 | 36,42 -1,00 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS 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 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | -1,97 0,01 | -1,06 -0,07 | -1,06 -0,07 | 0,76 -0,13 | 8,07 -0,40 | 17,87 -0,92 | 30,31 -1,28 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p. | -0,11 -0,01 | 1,36 -0,06 | 1,36 -0,06 | 3,20 -0,11 | 10,78 -0,31 | 20,64 -0,61 | 35,89 -0,97 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI | -5,31 -1.569,83 | -6,10 -603,06 | -6,10 -603,06 | -2,57 -113,42 | 6,44 118,45 | 17,36 143,17 | 30,99 143,93 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES Var. IBOVESPA p.p. | -29,71 0,19 | -36,62 0,24 | -36,62 0,24 | -30,06 0,23 | -23,40 0,08 | -14,79 -0,32 | 11,23 -1,13 |
| FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p. | -30,83 -0,93 | -37,86 -1,00 | -37,86 -1,00 | -31,29 -1,00 | -25,49 -2,02 | -19,51 -5,05 | 7,13 -5,24 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | -31,71 -1,81 | -35,29 1,57 | -35,29 1,57 | -28,84 1,45 | -13,47 10,00 | -1,01 13,45 | 30,58 18,21 |
| MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA | 6,48 | 6,48 | | | | | |

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. | -0,38 | -0,38 | | | | | |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | -31,06 | -34,96 | -34,96 | -26,97 | -16,95 | -1,94 | 28,49 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,15 | 1,90 | 1,90 | 3,32 | 6,52 | 12,52 | 16,13 |
| 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 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | -30,69 | -36,11 | -36,11 | -28,12 | -21,54 | -9,49 | 19,44 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,78 | 0,75 | 0,75 | 2,17 | 1,93 | 4,98 | 7,07 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | -27,59 | -32,65 | -32,65 | -20,51 | -11,04 | 0,67 | 19,76 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 2,32 | 4,21 | 4,21 | 9,78 | 12,44 | 15,13 | 7,40 |
| ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC | -32,44 | -39,18 | -39,18 | -31,38 | -17,47 | -4,42 | |
| MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | -36,49 | -42,43 | -42,43 | -34,82 | -22,81 | -5,17 | |
| 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 | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|--|--------------|--------------|------------------|---------------|
| 05/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 4.571,71 | 2.185,80405000 | 2,0915461290 |
| 06/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 300.000,00 | 117.847,67624900 | 2,5456590000 |
| 06/03/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 900.000,00 | 397.608,33356600 | 2,2635340460 |
| 06/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 299.993,74 | 0,00 | 143.414,46720300 | 2,0917955200 |
| 09/03/2020 | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 300.000,00 | 0,00 | 81.841,71131000 | 3,6656125000 |
| 09/03/2020 | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 300.000,00 | 0,00 | 127.482,66108327 | 2,3532612000 |
| 10/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 3.460,69 | 0,00 | 1.654,02989400 | 2,0922777830 |
| 16/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 826.052,68 | 324.106,94795800 | 2,5487040000 |
| 16/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 316.274,07 | 0,00 | 124.092,11505100 | 2,5487040000 |
| 16/03/2020 | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 826.052,68 | 0,00 | 44.603,92673111 | 18,5197300000 |
| 16/03/2020 | BB PREV RF IRF-M1 | 0,00 | 826.052,68 | 310.351,75807900 | 2,6616658630 |
| 16/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 3,13 | 1,49525200 | 2,0932927420 |
| 16/03/2020 | MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | 826.052,68 | 0,00 | 354.355,07863757 | 2,3311439000 |
| 18/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.158.009,91 | 0,00 | 553.068,21357800 | 2,0937921997 |
| 19/03/2020 | MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | 0,00 | 1.291.082,01 | 615.218,33884159 | 2,0985753000 |
| 19/03/2020 | MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA | 1.291.082,01 | 0,00 | 615.218,33884159 | 2,0985753000 |
| 19/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 200.000,00 | 0,00 | 78.465,92832800 | 2,5488770000 |
| 19/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 1.000.003,13 | 477.547,54267200 | 2,0940388980 |
| 20/03/2020 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | 200.000,00 | 0,00 | 73.191,33238900 | 2,7325640000 |
| 20/03/2020 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES | 200.000,00 | 0,00 | 130.766,90211200 | 1,5294390000 |
| 20/03/2020 | FIA BRASIL IBX-50 | 200.000,00 | 0,00 | 236.627,86364000 | 0,8452090000 |
| 20/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 448,10 | 0,00 | 175,78863600 | 2,5490840000 |
| 20/03/2020 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT | 200.000,00 | 0,00 | 180.770,04423400 | 1,1063780000 |
| 24/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 4.436,55 | 0,00 | 2.118,01254700 | 2,0946759760 |
| 26/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 348.685,11 | 136.535,41979000 | 2,5538070000 |
| 31/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 24.832,72 | 11.849,16927900 | 2,0957351030 |

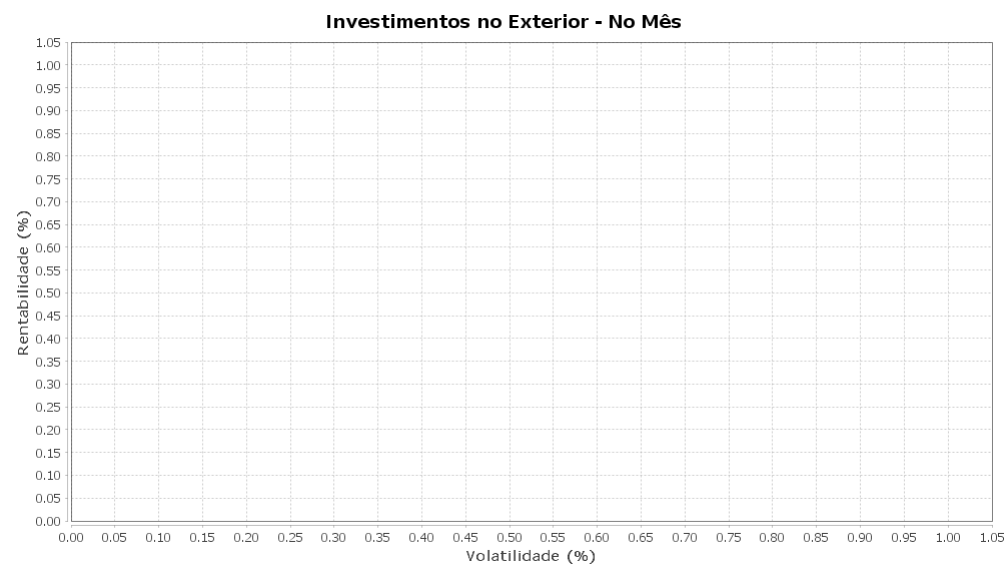
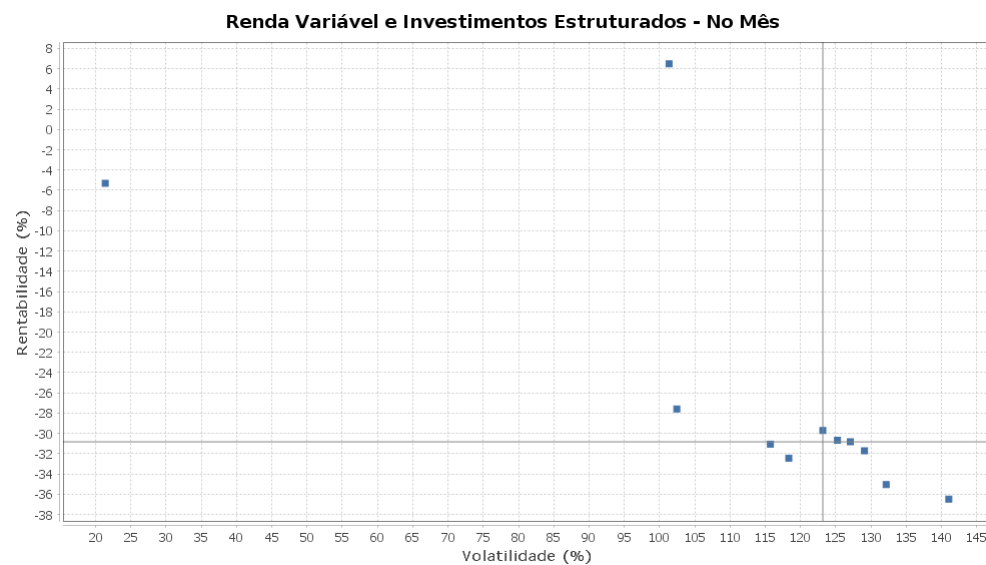
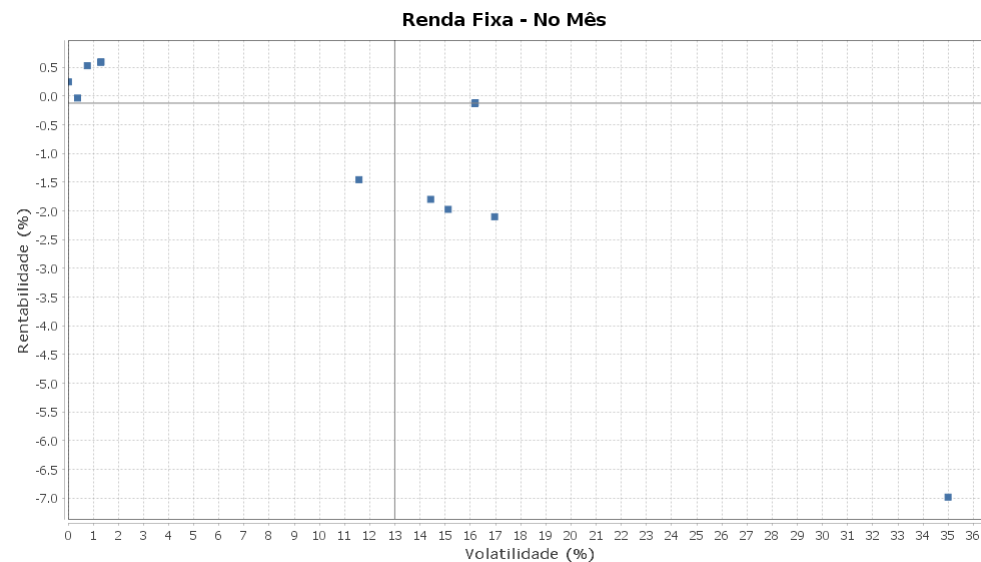
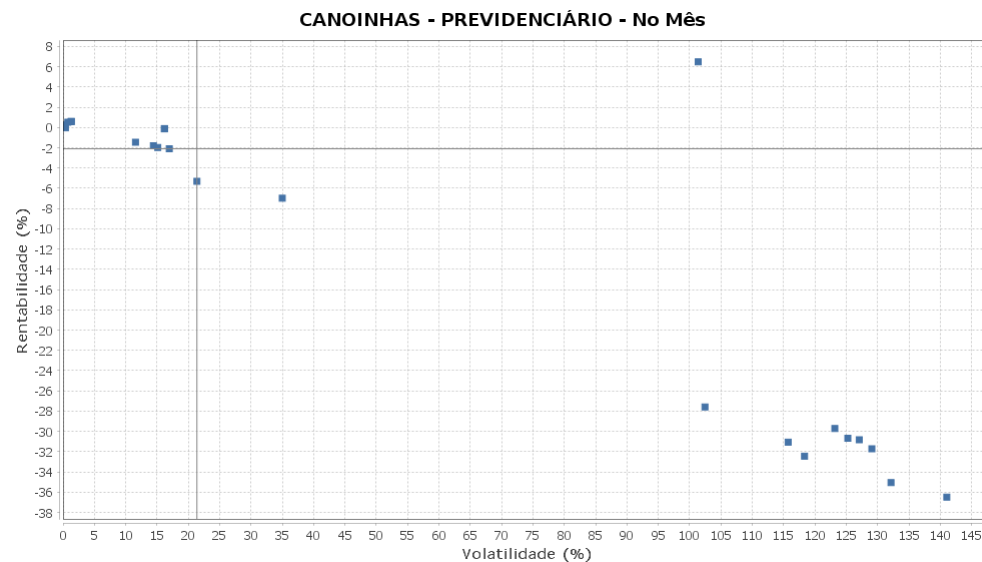
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

| Artigo | Ativo | Quantidade | Valor Aplicação | Valor Resgate | Rendimento |
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|-------|--------|--------------|------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,02 | 0,01 | 0,25 | 495.072,00 | 1,45 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,38 | 0,04 | -0,03 | 115.324,51 | 0,34 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,77 | 0,10 | 0,53 | 1.443.891,24 | 4,24 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 1,30 | 0,16 | 0,59 | 355.225,48 | 1,04 |
| BB PREV RF IRF-M1 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,31 | 0,16 | 0,60 | 2.685.550,25 | 7,89 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 11,57 | 1,13 | -1,45 | 1.674.381,47 | 4,92 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 14,42 | 1,41 | -1,80 | 4.654.237,31 | 13,68 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 15,12 | 1,48 | -1,97 | 919.656,47 | 2,70 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 16,18 | 1,67 | -0,13 | 3.464.071,87 | 10,18 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 16,19 | 1,67 | -0,11 | 4.296.818,89 | 12,63 |
| BB PREV ALOC FIC | Artigo 7º I, Alínea b | 16,96 | 1,66 | -2,10 | 1.705.857,25 | 5,01 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | Artigo 8º III | 21,37 | 1,97 | -5,31 | 426.757,53 | 1,25 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 34,99 | 3,30 | -6,98 | 5.234.155,21 | 15,38 |
| MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 101,35 | 11,29 | 6,48 | 1.374.795,82 | 4,04 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 102,45 | 9,15 | -27,59 | 430.574,71 | 1,27 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | Artigo 8º II, Alínea a | 115,72 | 10,30 | -31,06 | 971.792,93 | 2,86 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | Artigo 8º II, Alínea a | 118,33 | 10,48 | -32,44 | 606.052,86 | 1,78 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES | Artigo 8º I, Alínea a | 123,17 | 11,16 | -29,71 | 779.646,43 | 2,29 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 125,25 | 11,31 | -30,69 | 415.383,55 | 1,22 |
| FIA BRASIL IBX-50 | Artigo 8º I, Alínea a | 127,07 | 11,49 | -30,83 | 766.617,35 | 2,25 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 129,09 | 11,64 | -31,71 | 798.108,33 | 2,35 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT | Artigo 8º II, Alínea a | 132,15 | 11,73 | -35,06 | 412.396,25 | 1,21 |
| MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 141,04 | 12,55 | -36,49 | 0,00 | 0,00 |