



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
ABRIL 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 05.01.2021.

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

74,73%

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 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,41	1,79	60.765,38	0,01	7.168.032.689,23	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,27	1,27	-5,20	13.234.135,79	2,10	710.454.935,91	1,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,33	1,30	-5,25	102.793.815,73	16,35	5.880.207.997,15	1,75
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,42	1,79	15.166,32	0,00	282.541.408,55	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,43	1,82	77.827,34	0,01	10.765.141.210,50	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,47	-0,18	107.670.206,29	17,12	9.104.032.681,09	1,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,31	1,26	-5,37	18.902.788,12	3,01	1.212.263.386,57	1,56
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,78	1,13	2,50	35.894.777,58	5,71	16.130.391.856,09	0,22
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	8,86	0,90	0,44	2.349.753,17	0,37	572.988.052,24	0,41
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,49	-0,12	12.611.755,53	2,01	4.608.504.106,72	0,27
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,47	0,39	-0,07	15.571.567,34	2,48	513.095.735,43	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,01	0,91	-0,28	54.339.266,38	8,64	10.512.346.440,60	0,52
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,00	1,11	2,43	64.770.096,62	10,30	11.368.843.034,79	0,57
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,11	0,33	-0,42	4.320.263,54	0,69	867.930.109,24	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,20	0,93	-0,86	432.612.185,13	68,80		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,26	0,06	0,65	6.875.433,79	1,09	2.829.946.608,82	0,24
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	13,62	1,44	-5,44	5.496.245,04	0,87	307.300.531,89	1,79
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,26	1,22	-5,36	1.481.709,91	0,24	1.433.166.438,94	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,98	0,14	1,28	23.408.936,56	3,72	5.079.848.328,78	0,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,06	0,36	-0,16	37.262.325,30	5,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

6,87

0,88

-0,81

469.874.510,43

74,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,58%

Artigo 8º I, Alínea b (Fundos de Índices Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	75,39	10,25	-30,38	25.443.882,74	4,05	6.334.274.508,91	0,40
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			75,39	10,25	-30,38	25.443.882,74	4,05		

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	41,53	11,00	-33,39	3.339.209,30	0,53	492.702.661,97	0,68
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	36,92	6,08	-29,98	646.868,61	0,10	1.392.329.916,92	0,05
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	45,04	13,44	-35,54	13.119.981,08	2,09	527.391.430,97	2,49
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	38,93	10,92	-28,05	20.822.952,63	3,31	235.257.525,45	8,85
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	39,71	9,76	15,37	7.614.097,33	1,21	422.453.825,33	1,80
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	46,91	14,21	-31,08	13.964.394,48	2,22	551.205.524,50	2,53
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	39,44	8,39	-29,05	1.586.275,99	0,25	659.703.695,70	0,24
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	37,40	7,24	-25,99	8.632.454,61	1,37	714.263.825,61	1,21
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	46,12	12,64	20,29	7.939.356,40	1,26	626.935.624,99	1,27
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	46,56	6,08	0,25	6.616.602,69	1,05	157.024.203,93	4,21
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	47,16	15,07	-8,01	1.207.768,79	0,19	671.882.137,05	0,18
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	35,45	6,75	-26,10	11.027.090,32	1,75	156.962.700,84	7,03
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,16	10,56	-30,61	96.517.052,23	15,35		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	31,44	11,77	-11,92	10.332.443,44	1,64	773.176.553,31	1,34
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,67	1,29	2,47	3.401.708,60	0,54	188.882.864,22	1,80
Sub-total Artigo 8º III			24,02	8,98	-8,75	13.734.152,04	2,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	37,58	10,34	-26,16	135.695.087,01	21,58
---	-------	-------	--------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,69%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,13	18,08	34,93	2.751.093,31	0,44	10.850.193,94	25,36
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,47	17,78	33,59	15.076.619,08	2,40	165.085.634,35	9,13
Sub-total Artigo 9º A, II			24,58	17,84	34,02	17.827.712,39	2,84		

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
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	29,08	16,94	18,54	5.389.101,20	0,86	949.289.216,91	0,57
Sub-total Artigo 9º A, III			29,08	16,94	18,54	5.389.101,20	0,86		
Investimentos no Exterior			24,61	17,60	24,93	23.216.813,59	3,69		
Total			10,40	3,28	-2,50	628.786.411,03	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	432.612.185,13	68,80	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	37.262.325,30	5,93	2,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	469.874.510,43	74,73				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	25.443.882,74	4,05	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	96.517.052,23	15,35	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	13.734.152,04	2,18	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	135.695.087,01	21,58				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	17.827.712,39	2,84	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.389.101,20	0,86	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.216.813,59	3,69				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

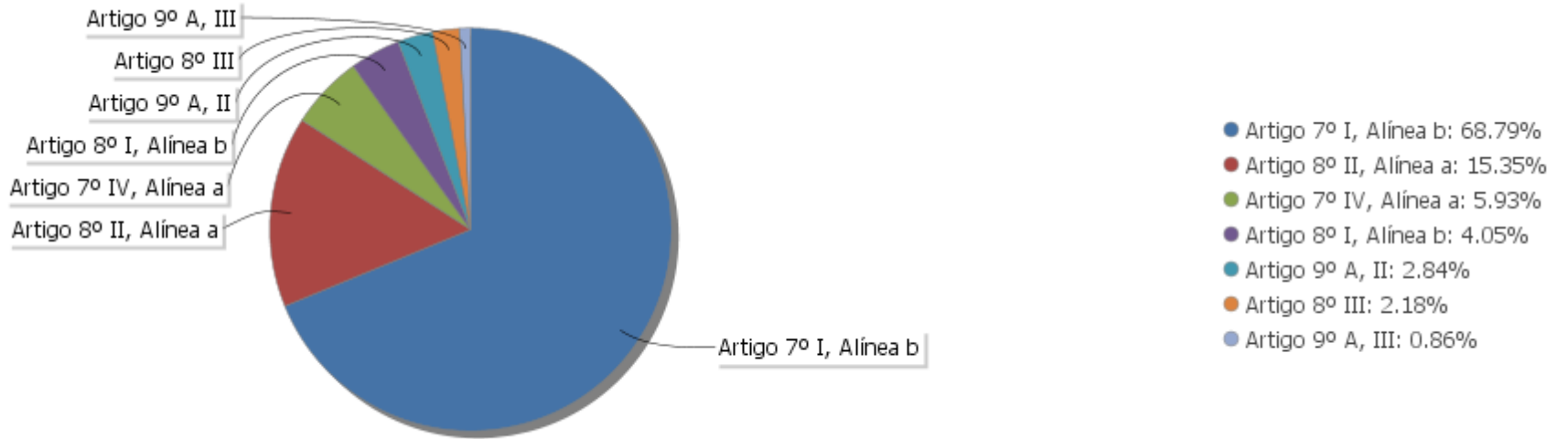
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,93 326,19	-0,86 -66,00	-1,40 -152,10	-0,75 -36,11	9,15 176,22	3.983.618,83	-6.372.261,25
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,36 125,83	-0,16 -12,03	-0,48 -52,64	0,28 13,75	7,58 146,02	141.086,54	-58.349,38
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	10,25 -0,00	-30,38 0,00	-29,22 0,01	-26,70 -1,79		2.364.998,70	1.488.045,96
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,56 0,31	-30,61 -0,23	-31,49 -2,26	-23,07 1,85	-10,38 6,07	9.217.792,11	-13.666.037,65
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	8,98 -1,27	-8,75 21,64	-9,11 20,12	-3,95 20,97	0,61 17,06	1.131.571,90	-1.316.155,62
Artigo 9º A, II % do CDI	17,84 6.259,62	34,02 2.616,98	23,14 2.515,89			2.274.714,38	3.674.431,16
Artigo 9º A, III % do CDI	16,94 5.945,28	18,54 1.426,56	10,82 1.176,65	24,77 1.198,56		780.655,39	590.165,11
MOGI DAS CRUZES (Total)						19.894.437,85	-15.660.161,67

Análise de Liquidez

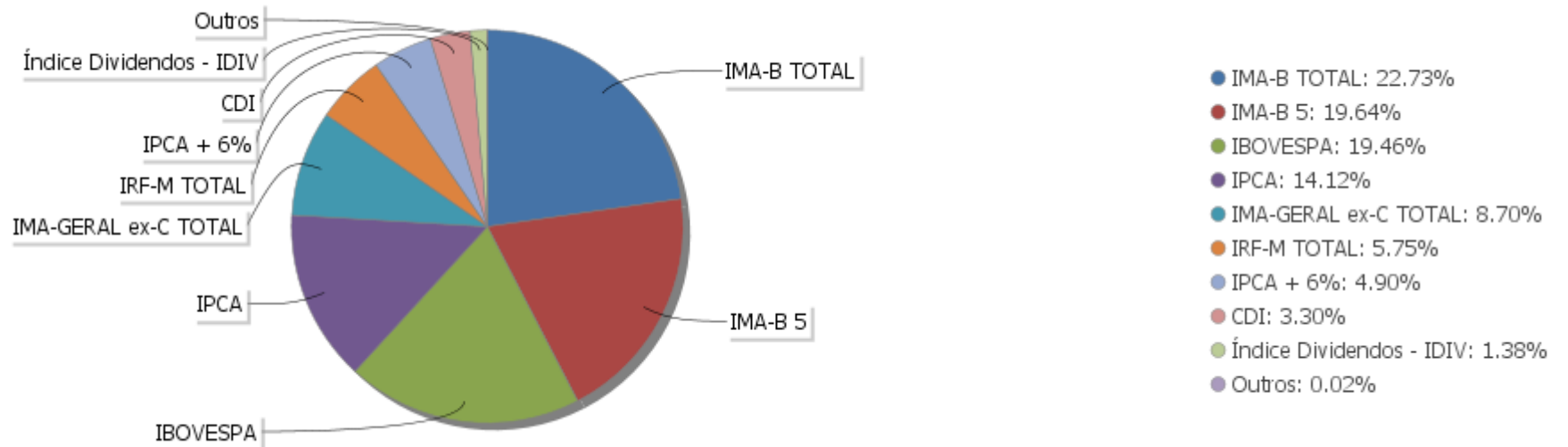
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	561.333.629,86	89,27	561.333.629,86	89,27
de 31 a 364 dias	47.560.950,29	7,56	608.894.580,15	96,84
acima de 365 dias	19.891.830,88	3,16	628.786.411,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

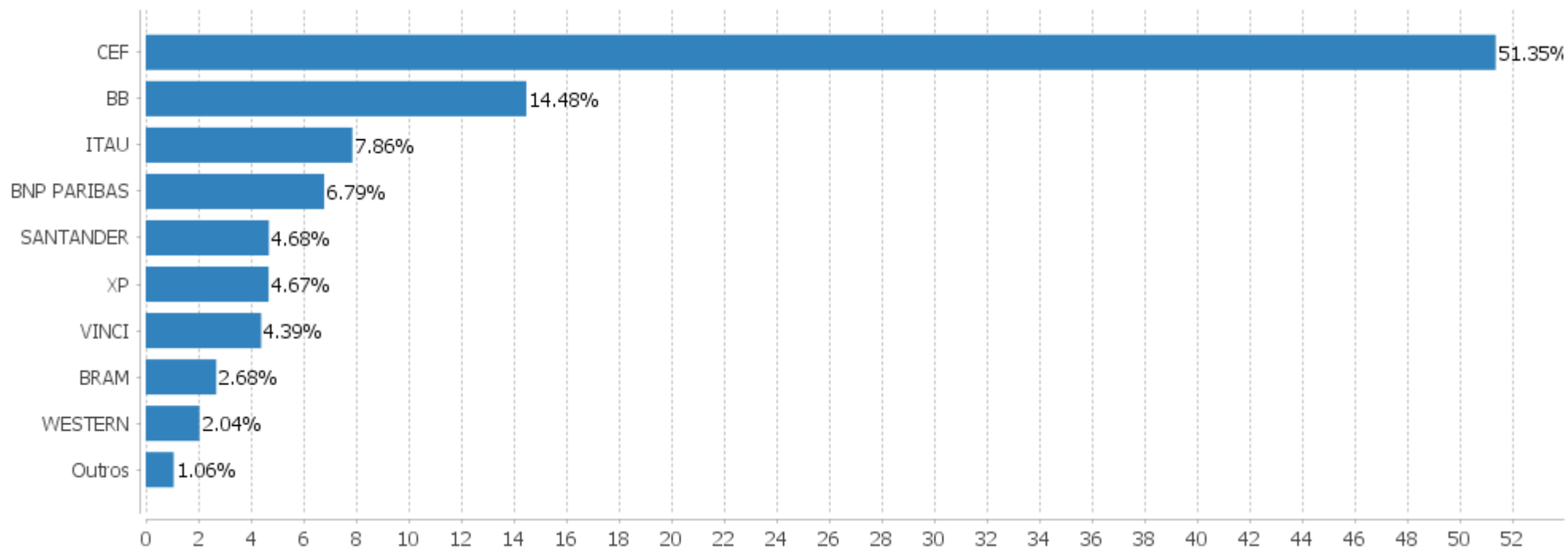


Alocação Por Estratégia



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	0,64	-0,53	-5,69	3,28									-2,50
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14									2,09
p.p. indexador	-0,07	-1,19	-6,26	3,14									-4,59
2019	2,62	0,40	0,42	1,14	1,92	2,62	1,15	-0,04	2,03	2,09	-0,62	1,88	16,71
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	1,79	-0,50	-0,77	0,09	1,28	2,17	0,42	-0,66	1,58	1,46	-1,59	0,24	6,12
2018	1,78	0,59	0,91	0,37	-1,50	0,13	1,83	-0,52	0,58	3,66	0,79	1,09	10,06
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	0,98	-0,15	0,34	-0,34	-2,38	-1,62	0,99	-0,96	-0,34	2,70	0,53	0,48	0,14

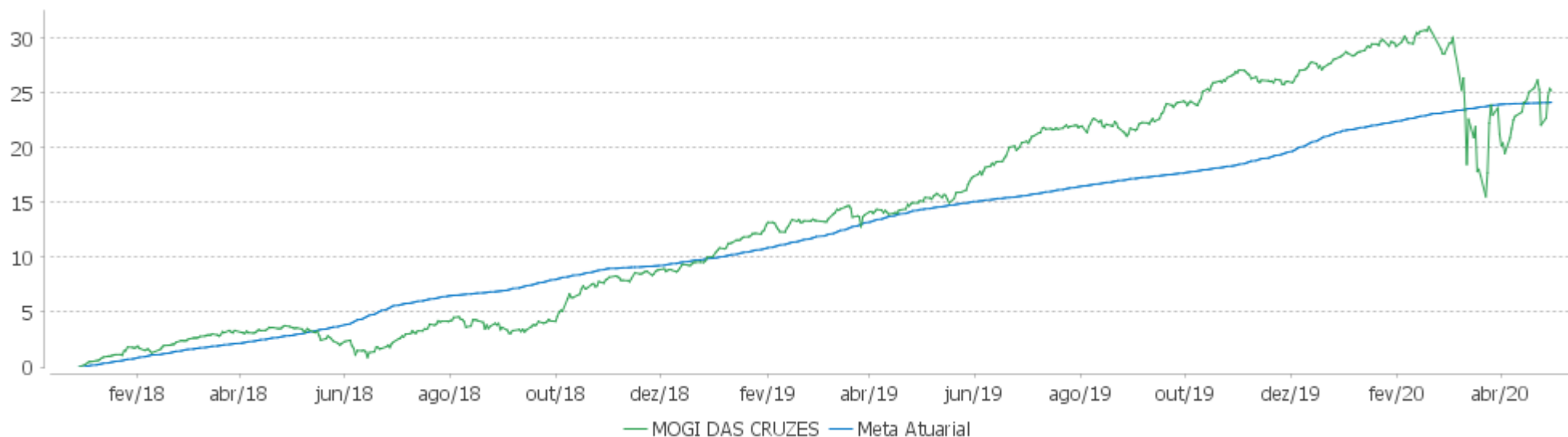
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

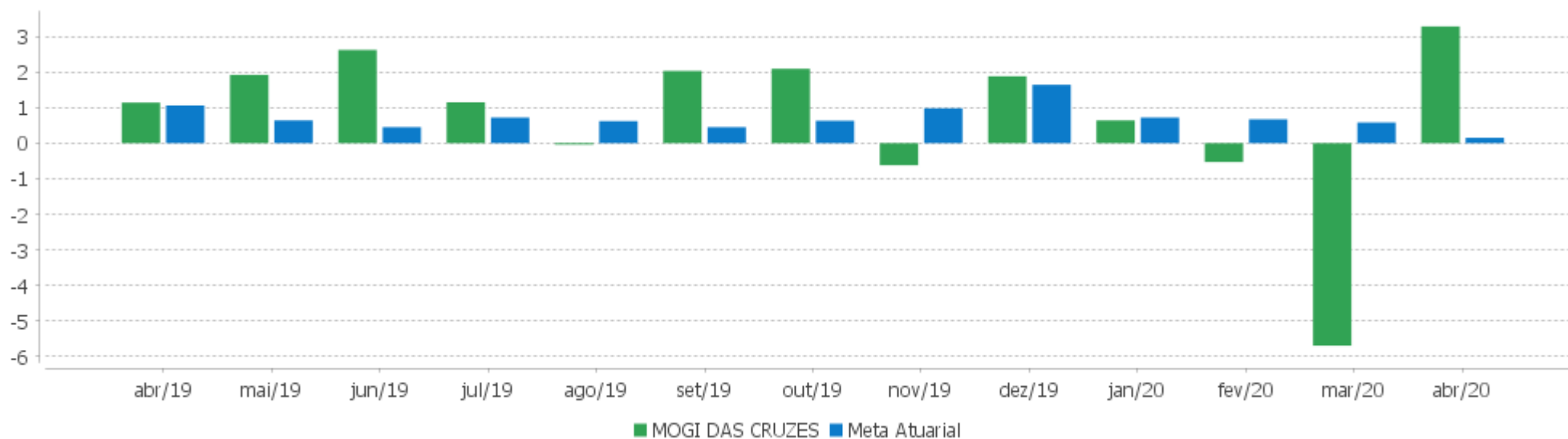
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	15	53,57	03 meses	-3,11	1,37	-4,49	20,68
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	46,43	06 meses	-1,27	4,78	-6,06	14,53
			12 meses	8,75	8,52	0,22	10,40
			24 meses	20,78	20,66	0,12	7,79
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10	Desde 29/12/2017	25,24	24,10	1,14	7,25
Menor rentabilidade da Carteira	-5,69	2020-03					

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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,01	-5,25 -0,17	-5,48 -0,15	-5,82 -0,27	8,47 -0,47	25,17 -0,75	38,56 -1,12
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,90 0,41	0,44 0,53	-0,46 0,18	0,82 -0,04	11,43 2,76	23,76 4,30	40,15 6,77
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,47 -0,02	-0,18 -0,09	-0,72 -0,08	0,68 -0,18	8,37 -0,30	18,91 -0,56	32,52 -0,86
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,41 -0,03	1,79 -0,09	1,37 -0,07	2,51 -0,14	6,31 -0,29	13,19 -0,53	23,04 -0,85
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,49 -0,00	-0,12 -0,03	-0,67 -0,03	0,76 -0,10	8,48 -0,19	19,01 -0,46	32,65 -0,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,13 -0,02	2,50 -0,09	1,65 -0,05	2,62 -0,13	11,40 -0,29	21,56 -0,51	36,77 -0,92
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,33 0,10	-0,42 -2,65	-0,84 -2,36	0,62 -4,41	7,80 -0,83	28,29 7,35	40,16 9,86
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -0,04	-5,20 -0,12	-5,42 -0,10	-5,72 -0,17	8,54 -0,39	24,98 -0,94	38,02 -1,66
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91 0,07	-0,28 -0,10	-0,76 -0,09	-0,26 -0,29	8,60 0,26	19,45 0,41	31,58 -0,29
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,39 0,24	-0,07 -2,21	-0,61 -2,02	0,83 -3,99	8,54 -0,02	29,24 8,53	40,81 9,38
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,03	1,79 -0,09	1,36 -0,07	2,52 -0,13	6,33 -0,27	13,30 -0,42	23,27 -0,62
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,11 1,42	2,43 2,22	1,60 1,59	2,52 0,63	13,47 11,07	24,61 17,15	36,68 26,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,43 -0,01	1,82 -0,07	1,39 -0,04	2,55 -0,10	6,39 -0,21	13,32 -0,40	23,25 -0,64
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,06	-5,37 -0,29	-5,60 -0,27	-5,88 -0,33	8,37 -0,56	24,95 -0,96	38,35 -1,33
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 -0,09	-5,36 -0,28	-5,60 -0,28	-5,85 -0,30	8,39 -0,55	25,02 -0,90	38,51 -1,17
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,44 0,12	-5,44 -0,36	-5,70 -0,37	-6,14 -0,59	9,05 0,11	25,66 -0,26	39,07 -0,62
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,06	0,65	0,27	1,33	4,34	10,94	20,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	21,74	49,65	29,31	64,50	83,61	92,16	95,75
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 0,45	1,28 1,06	0,93 0,92	1,98 0,09	9,19 6,79	18,37 10,91	30,21 19,78
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	11,77 4.132,19	-11,92 -916,99	-12,24 -1.330,94	-6,15 -297,51	-1,79 -34,38	14,06 118,49	34,29 163,86
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	1,29 451,47	2,47 190,39	1,94 210,97	3,42 165,45	8,13 156,53	12,85 108,29	26,03 124,37
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	10,92 0,66	-28,05 2,33	-27,50 1,74	-22,83 2,09	-12,03 4,42	2,31 8,82	14,48 -8,62
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	9,76 -0,50	-28,15 2,24	-29,52 -0,29	-17,60 7,32	-1,76 14,69	13,43 19,95	49,59 26,49
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,08 -4,17	-29,93 0,45	-30,35 -1,12	-24,36 0,55			
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,24 3,48	-25,99 2,66	-27,10 0,40	-19,26 0,43	-7,99 -0,81	9,76 -0,62	28,84 -1,91
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	15,07 4,82	-27,77 2,62	-29,26 -0,03	-16,83 8,08	2,86 19,31		
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	11,00 0,75	-33,39 -3,01	-32,95 -3,72	-27,20 -2,29	-18,50 -2,05	-6,00 0,52	21,22 -1,88
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,08 -4,18	-29,98 0,41	-30,41 -1,18	-24,37 0,54	-11,75 4,69	9,04 15,56	36,68 13,59
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	13,44 3,19	-35,54 -5,16	-36,82 -7,59	-23,56 1,35	-6,97 9,48	-0,49 6,02	25,18 2,09
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,75 -3,50	-26,10 4,29	-27,77 1,46	-17,38 7,53	-4,35 12,10	15,30 21,81	
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	14,21 3,96	-31,08 -0,70	-33,25 -4,02	-21,42 3,50	-5,61 10,84	5,46 11,98	47,56 24,47
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	12,64 2,39	-27,85 2,54	-30,07 -0,84	-19,61 5,30			
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,39 -1,86	-29,05 1,34	-28,01 1,22	-20,57 4,34	-13,78 2,67	5,57 12,09	
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	10,25 -0,00	-30,38 0,00	-29,22 0,01	-24,85 0,06	5,50 21,95		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	16,94 6,69	18,54 48,93	10,82 40,06	24,77 49,68	33,82 50,27	80,10 86,61	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,08	34,93	23,94	45,13	50,22		

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.	7,83	65,32	53,17	70,05	66,67		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,78	33,59	22,77				
Var. IPCA + 6% p.p.	17,63	31,46	21,37				
MOGI DAS CRUZES	3,28	-2,50	-3,11	-1,27	8,75	20,78	
Var. IPCA + 6% p.p.	3,13	-4,63	-4,52	-6,10	0,18	0,07	
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

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	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
Renda Variável							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,96	6,68	15,90	18,09
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

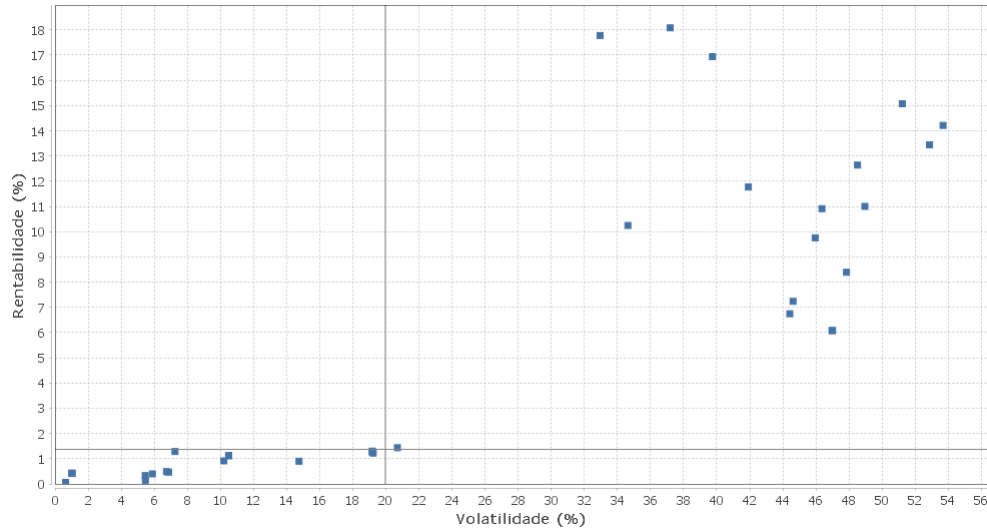
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
67	02/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	16.000,00	86,92397100	184,0689034000
73	02/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	284.219,56	1.544,09329800	184,0689034000
74	02/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	204.769,78	1.112,46265500	184,0689034000
75	02/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.423.010,66	13.163,60679300	184,0689034000
66	09/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	434.000,00	0,00	2.359,94511300	183,9025822000
70	09/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.555.000,00	0,00	24.768,54835600	183,9025822000
71	09/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	2.799.000,00	0,00	15.220,01467600	183,9025822000
68	15/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	21.000,00	114,16032200	183,9518291000
76	15/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.958.000,00	10.644,09095400	183,9518291000
72	16/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	120.100,86	0,00	652,71146200	184,0029892000
69	29/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	5.000,00	27,14646300	184,1860642000
77	29/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.684.779,65	14.576,45377100	184,1860642000
78	29/04/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	120.220,35	652,71146200	184,1860642000
83	30/04/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.799.000,00	0,00	20.349,67136204	137,5452188000

Total

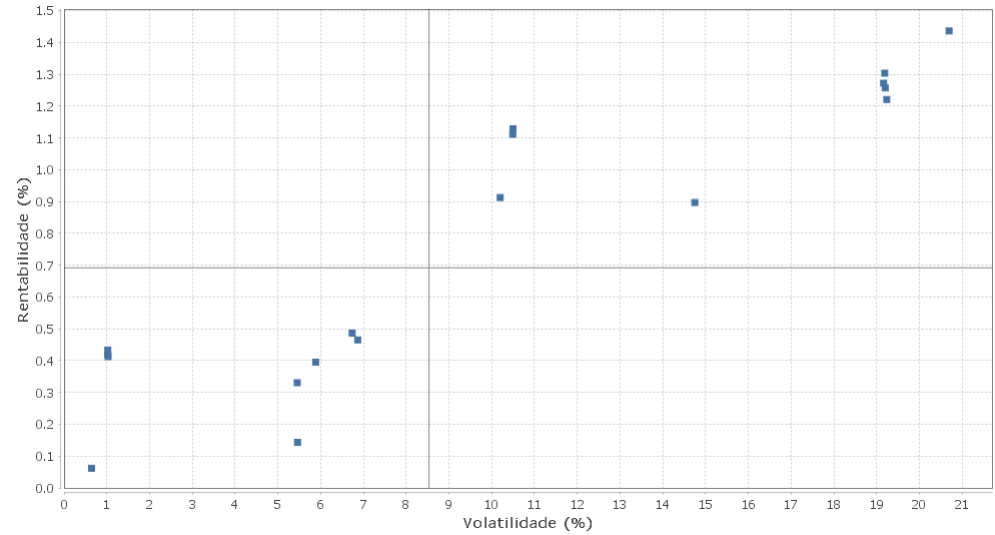
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

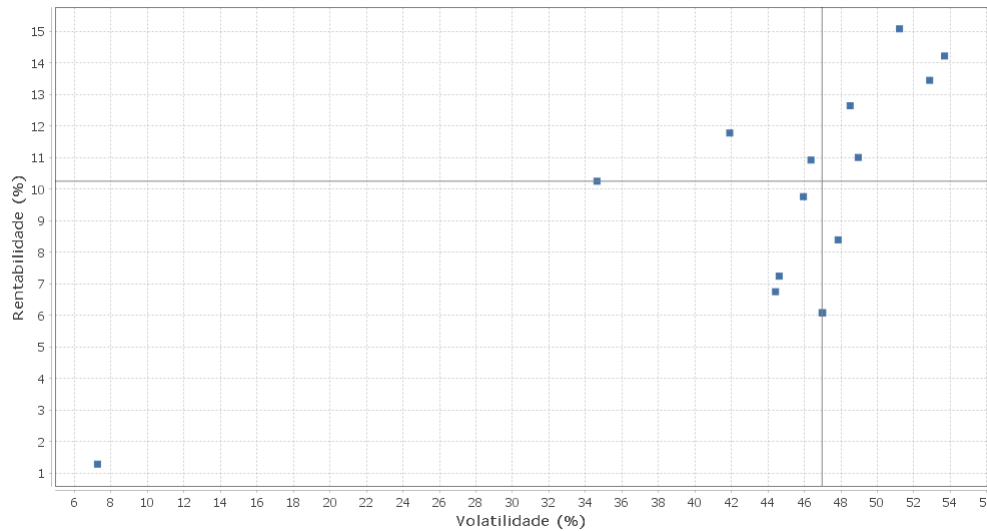
MOGI DAS CRUZES - No Mês



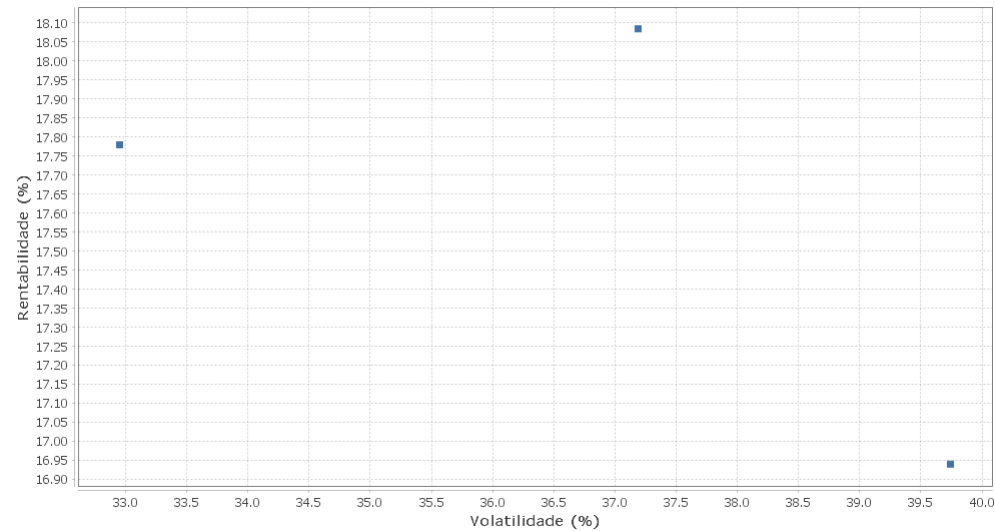
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 50.090.357,33

Value-At-Risk: 7,97%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,64	0,20	-0,00	-0,35	0,06	6.875.433,79	1,09
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,02	0,29	0,00	0,13	0,42	15.166,32	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,02	0,29	0,00	0,14	0,43	77.827,34	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,29	0,00	0,12	0,41	60.765,38	0,01
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,45	2,40	0,01	0,01	0,33	4.320.263,54	0,69
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	5,46	0,45	0,01	-0,03	0,14	23.408.936,56	3,72
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,88	2,33	0,04	0,02	0,39	15.571.567,34	2,48
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,74	2,33	0,04	0,03	0,49	12.611.755,53	2,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,87	2,81	0,40	0,03	0,47	107.670.206,29	17,12
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	7,25	2,99	0,01	0,14	1,29	3.401.708,60	0,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	3,91	0,31	0,06	0,91	54.339.266,38	8,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,49	2,83	0,25	0,08	1,11	64.770.096,62	10,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,50	2,84	0,14	0,08	1,13	35.894.777,58	5,71
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	14,75	4,90	0,02	0,04	0,90	2.349.753,17	0,37
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	19,16	9,72	0,19	0,05	1,27	13.234.135,79	2,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	19,19	9,69	1,45	0,05	1,30	102.793.815,73	16,35
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	19,20	9,79	0,27	0,05	1,26	18.902.788,12	3,01
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	19,24	9,71	0,02	0,05	1,22	1.481.709,91	0,24
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	20,70	10,36	0,08	0,06	1,44	5.496.245,04	0,87
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	32,95	14,28	0,09	0,53	17,78	15.076.619,08	2,40
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	34,63	13,98	0,04	0,29	10,25	25.443.882,74	4,05
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	37,19	20,60	0,05	0,48	18,08	2.751.093,31	0,44
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	39,74	21,66	0,12	0,42	16,94	5.389.101,20	0,86
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	41,91	21,63	0,28	0,27	11,77	10.332.443,44	1,64
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	44,42	26,26	0,44	0,15	6,75	11.027.090,32	1,75
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	44,62	28,31	0,37	0,16	7,24	8.632.454,61	1,37
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	45,95	28,17	0,33	0,21	9,76	7.614.097,33	1,21
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	46,36	26,67	0,84	0,23	10,92	20.822.952,63	3,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	46,97	29,89	0,30	0,12	6,08	6.616.602,69	1,05
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,00	29,90	0,03	0,12	6,08	646.868,61	0,10
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,85	30,19	0,07	0,17	8,39	1.586.275,99	0,25
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	48,51	29,14	0,33	0,25	12,64	7.939.356,40	1,26
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	48,95	31,26	0,16	0,22	11,00	3.339.209,30	0,53
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	51,22	31,54	0,06	0,29	15,07	1.207.768,79	0,19
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	52,87	28,60	0,57	0,25	13,44	13.119.981,08	2,09
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	53,69	30,66	0,65	0,26	14,21	13.964.394,48	2,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

- Referente ao mês de abril de 2020, vale observar que o Instituto está com 25,36% do patrimônio líquido do fundo ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (Art. 9 A, Inciso II), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Saliencamos também que de acordo com informações provenientes da Nota Técnica nº 12/2017/CGAI/SRPPS/SPREV-ME, versão 09 de 17/09/2019, mais especificamente a questão de número 59, existe o entendimento de que para a verificação do limite máximo de alocação no segmento de investimentos no exterior, dispostos no art. 9º-A, considera-se o patrimônio líquido do fundo constituído no exterior;
- No final do respectivo mês, abril de 2020, os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 15,92% dos recursos totais do Instituto, alocação esta superior ao limite máximos estipulado em Política de Investimentos.