



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
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 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 85,82%

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	0,26	0,35	0,77	60.156,36	0,01	7.492.585.716,79	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,90	0,43	0,66	14.052.775,14	2,20	748.077.616,53	1,88
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,91	0,44	0,69	109.229.106,97	17,08	6.609.422.706,56	1,65
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,35	0,78	15.014,77	0,00	259.945.817,22	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,36	0,79	77.038,77	0,01	10.513.960.188,40	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,98	0,63	1,18	109.132.831,58	17,07	9.698.235.388,71	1,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	4,90	0,43	0,67	20.109.245,20	3,14	1.413.979.781,38	1,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,09	0,63	1,48	104.569.001,47	16,35	15.973.064.296,15	0,65
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,15	1,03	1,94	2.384.831,16	0,37	533.375.496,94	0,45
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,65	1,21	12.779.607,17	2,00	4.537.919.668,21	0,28
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	2,05	0,66	1,21	15.771.189,60	2,47	519.673.450,30	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,33	0,46	0,94	55.003.615,90	8,60	10.908.803.618,87	0,50
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,44	0,62	1,44	64.142.042,50	10,03	10.626.779.468,55	0,60
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,82	0,55	0,97	4.380.722,86	0,69	880.076.235,05	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,75	0,56	1,11	511.707.179,45	80,02		

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	0,07	0,28	0,66	6.704.554,88	1,05	4.610.254.170,62	0,15
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	5,40	0,40	0,66	5.851.257,60	0,91	392.819.709,83	1,49
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,89	0,40	0,67	1.575.997,37	0,25	1.649.350.516,71	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,69	0,26	0,60	22.979.181,29	3,59	5.092.614.949,01	0,45
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,74	0,29	0,62	37.110.991,14	5,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,67

0,54

1,07

548.818.170,59

85,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,03%

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	36,34	-8,41	-9,91	3.810.388,88	0,60	7.772.565.219,71	0,05
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			36,34	-8,41	-9,91	3.810.388,88	0,60		

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	18,99	-9,20	-9,80	4.522.150,65	0,71	689.674.752,99	0,66
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,61	-7,00	-6,42	864.483,61	0,14	1.963.717.198,95	0,04
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	18,74	-8,09	-6,24	7.106.802,85	1,11	826.272.513,20	0,86
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	16,11	-6,90	-7,62	15.979.534,51	2,50	314.388.186,30	5,08
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	19,06	-5,87	-2,81	19.692.852,40	3,08	739.096.749,04	2,66
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	18,81	-8,96	-10,27	2.006.064,85	0,31	798.991.874,74	0,25
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,49	-6,37	-4,94	11.087.923,19	1,73	909.648.393,83	1,22
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	15,82	-5,96	-3,79	4.021.318,55	0,63	180.305.968,92	2,23
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,30	-6,79	-5,60	65.281.130,61	10,21		

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	15,04	-7,50	-7,16	10.890.406,56	1,70	814.886.135,28	1,34
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	1,65	0,33	0,86	3.347.984,14	0,52	183.394.777,49	1,83
Sub-total Artigo 8º III			11,48	-5,77	-5,39	14.238.390,70	2,23		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,55	-6,69	-5,78	83.329.910,19	13,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,15%

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	16,18	2,89	12,01	945.478,92	0,15	5.625.795,74	16,81
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,57	-2,97	5,58	1.791.888,91	0,28	69.422.851,53	2,58
Sub-total Artigo 9º A, II			15,00	-1,03	7,72	2.737.367,83	0,43		

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	14,55	-5,24	1,37	4.608.212,67	0,72	849.143.050,83	0,54
Sub-total Artigo 9º A, III			14,55	-5,24	1,37	4.608.212,67	0,72		
Investimentos no Exterior			15,06	-3,69	3,76	7.345.580,50	1,15		
Total			3,56	-0,53	0,10	639.493.661,28	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	511.707.179,45	80,02	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	37.110.991,14	5,80	2,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	548.818.170,59	85,82				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	3.810.388,88	0,60	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	65.281.130,61	10,21	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	14.238.390,70	2,23	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	83.329.910,19	13,03				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	2.737.367,83	0,43	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	4.608.212,67	0,72	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	7.345.580,50	1,15				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

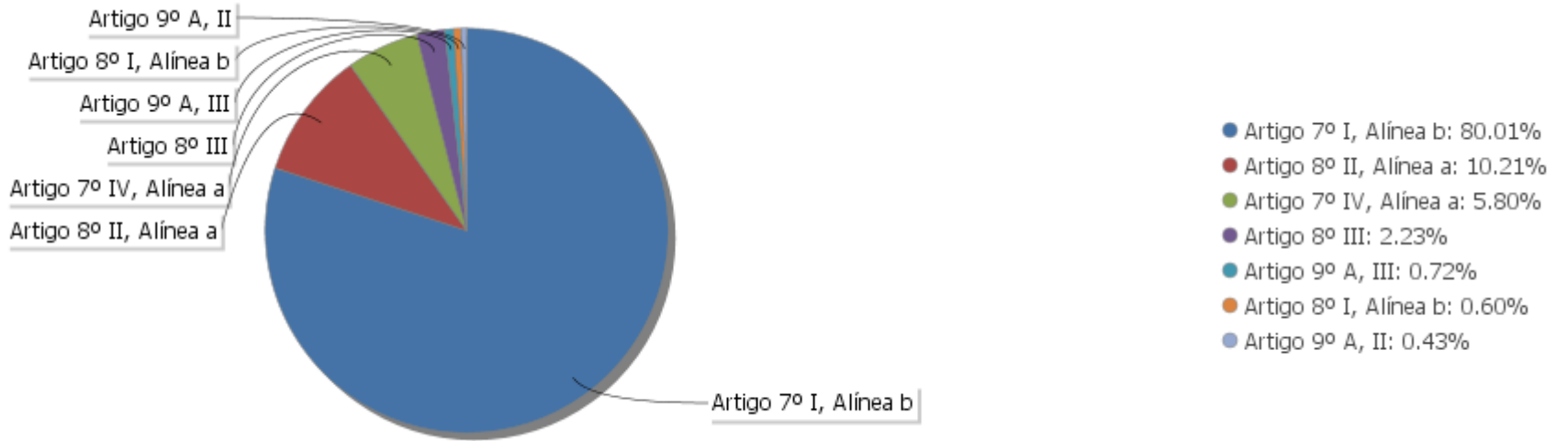
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,56 189,87	1,11 165,24	2,32 221,08	5,46 228,31	13,01 233,45	2.842.768,01	5.622.733,07
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,29 98,17	0,62 92,14	1,34 127,74	3,19 133,50	9,66 173,39	107.495,37	233.154,57
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-8,41 0,02	-9,91 0,01	-6,04 -2,29	0,43 -2,58		-349.808,31	-419.307,61
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,79 1,64	-5,60 4,32	2,66 6,41	10,50 7,50	23,65 14,67	-4.783.669,00	-3.988.959,27
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-5,77 2,66	-5,39 4,53	-3,28 0,48	3,51 0,50	9,48 0,50	-872.384,60	-811.916,96
Artigo 9º A, II % do CDI	-1,03 -349,30	7,72 1.149,15	5,28 503,08			-28.376,32	196.086,60
Artigo 9º A, III % do CDI	-5,24 -1.782,40	1,37 203,56	0,13 12,36	6,50 271,69		-318.784,54	-190.723,42
MOGI DAS CRUZES (Total)						-3.402.759,39	641.066,98

Análise de Liquidez

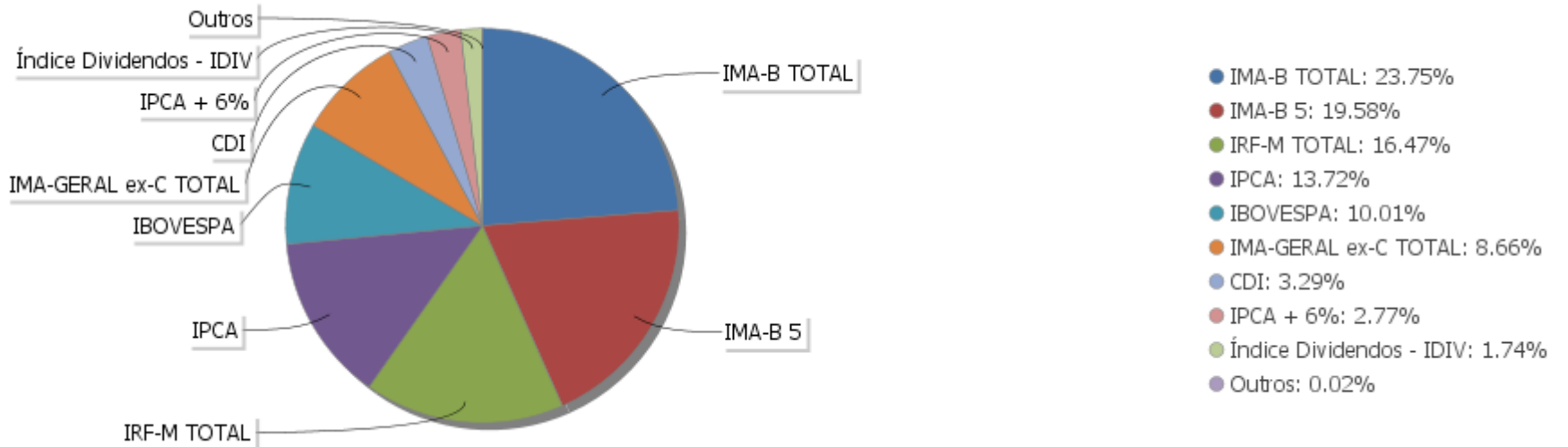
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	586.554.908,38	91,72	586.554.908,38	91,72
de 31 a 364 dias	32.786.840,44	5,13	619.341.748,82	96,85
acima de 365 dias	20.151.912,46	3,15	639.493.661,28	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

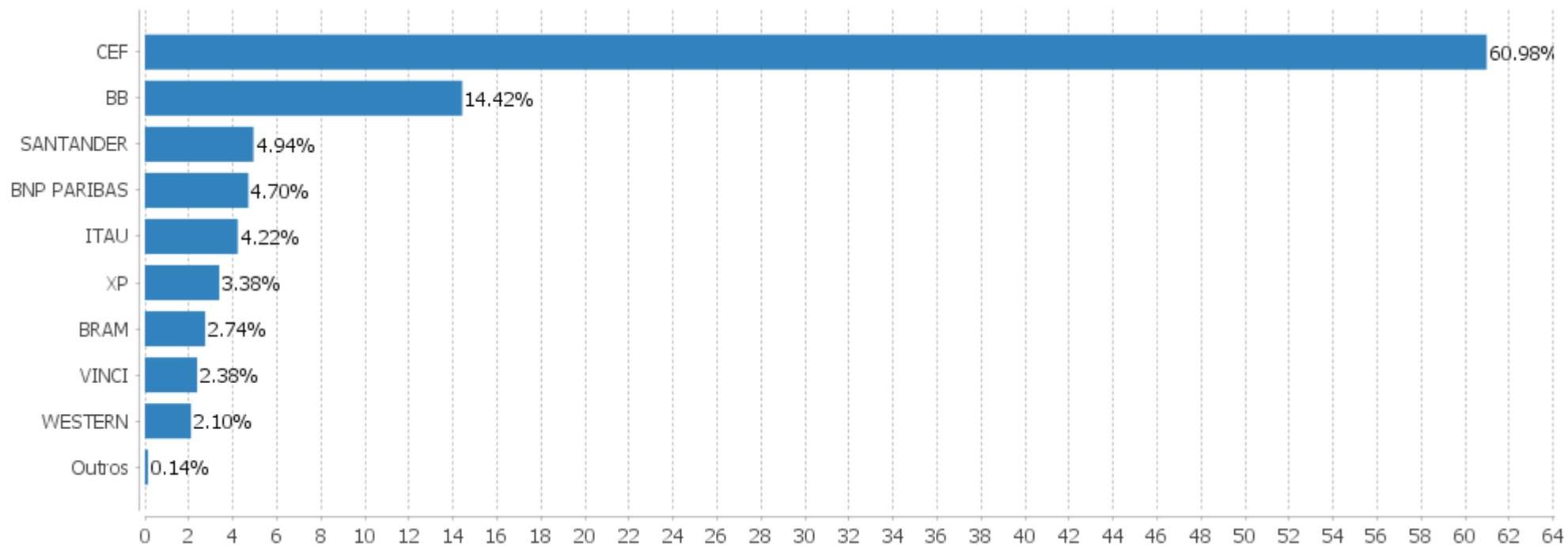


Alocação Por Estratégia



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											0,10
IPCA + 5,86%	0,71	0,66											1,37
p.p. indexador	-0,07	-1,19											-1,27
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

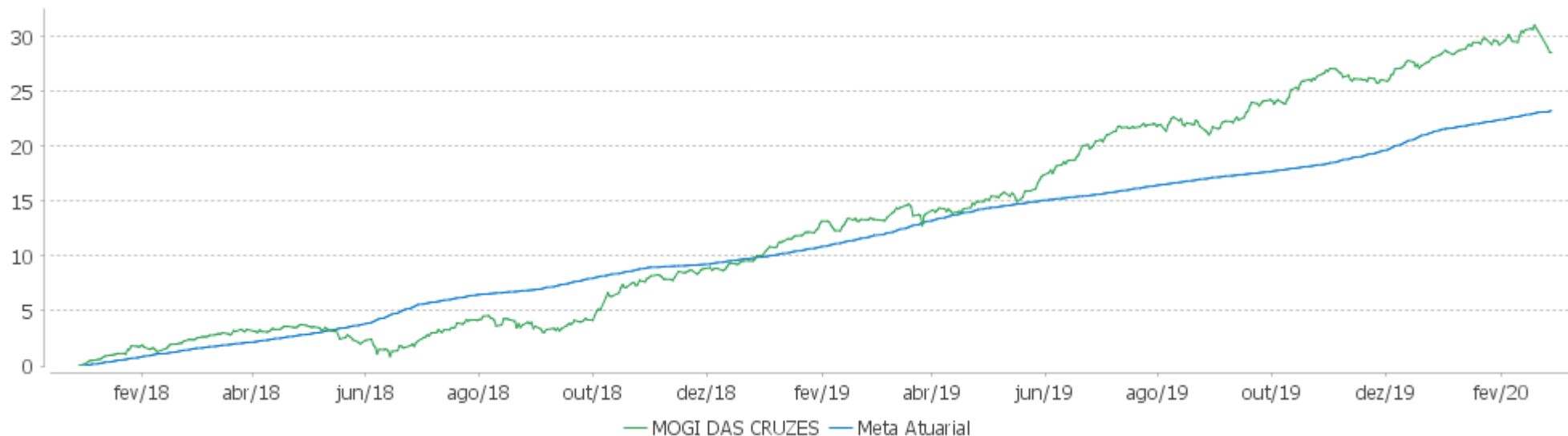
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

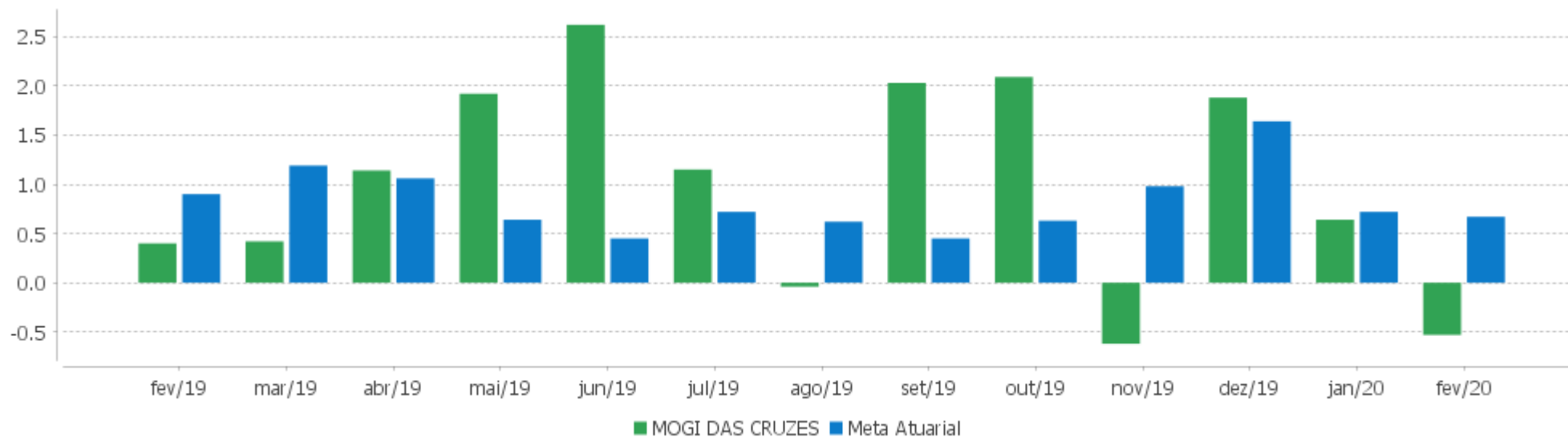
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	53,85	03 meses	1,99	3,04	-1,05	3,89
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	46,15	06 meses	5,58	5,17	0,41	3,42
			12 meses	13,40	10,20	3,20	3,56
			24 meses	25,59	21,35	4,24	3,39
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,66	2018-10	Desde 29/12/2017	28,58	23,23	5,35	3,31
Menor rentabilidade da Carteira	-1,50	2018-05					

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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 0,38	1,94 0,73	3,37 0,92	7,08 1,42	15,24 3,07	28,81 5,32	45,44 7,48
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	24,21 -0,86
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,65 0,01	1,21 0,01	2,42 -0,03	5,56 -0,09	11,96 -0,21	23,02 -0,47	37,23 -0,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,48 -0,06	2,09 -0,07	4,79 -0,12	11,51 -0,35	22,34 -0,65	37,98 -1,08
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,55 -0,04	0,97 -0,32	2,08 -0,95	5,04 -0,07	11,35 1,22	31,95 10,61	44,28 13,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB 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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,94 -0,00	1,91 0,05	4,31 -0,05	11,46 0,39	22,39 0,50	35,25 -0,19
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,66 -0,01	1,21 -0,18	2,35 -0,71	5,40 0,21	12,11 1,89	32,72 11,35	44,68 12,46
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,78 -0,05	1,18 -0,07	2,74 -0,13	6,26 -0,26	13,43 -0,42	24,46 -0,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,62 0,37	1,44 0,98	2,04 0,43	5,45 3,26	14,23 10,23	25,27 17,21	37,87 26,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS 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
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,02	0,67 -0,04	2,66 -0,07	6,41 -0,13	17,66 -0,34	33,92 -0,73	48,18 -1,08
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,05	0,67 -0,04	2,69 -0,04	6,42 -0,13	17,63 -0,37	33,97 -0,69	48,34 -0,92
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,05	0,66 -0,05	2,83 0,09	6,66 0,11	18,49 0,49	34,70 0,04	48,96 -0,31
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	0,26	0,60	0,95	2,60	9,60	19,17	31,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,01	0,14	-0,67	0,40	5,60	11,12	20,19
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,28 95,46	0,66 97,73	1,03 98,04	2,24 93,51	5,38 96,55	12,10 98,09	22,34 99,76
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-6,90 1,53	-7,62 2,30	-1,43 2,32	7,19 4,18	15,32 6,34	33,37 11,33	45,27 -11,00
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,37 -0,19	-4,94 2,72	3,17 1,61	8,42 0,89	19,87 -1,76	41,01 -1,30	66,74 -0,87
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-9,20 -0,77	-9,80 0,12	-2,75 1,00	2,54 -0,47	12,28 3,30	29,23 7,18	65,30 9,03
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,00 1,43	-6,42 3,50	0,61 4,36	5,66 2,66	21,20 12,22	49,95 27,91	85,08 28,81
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	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-8,09 0,34	-6,24 3,68	6,09 9,84	15,58 12,58	37,32 28,34	45,54 23,49	90,49 34,22
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,87 2,55	-2,81 7,11	6,87 10,62	15,67 12,66	33,78 24,80	57,92 35,87	
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,96 -0,53	-10,27 -0,35	-2,37 1,38	3,90 0,90	13,67 4,69	34,53 12,49	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-7,50 -2.554,49	-7,16 -1.066,88	-4,73 -451,48	3,26 136,25	10,30 184,80	17,58 142,47	45,11 201,46
BRDESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	0,33 112,55	0,86 127,56	1,80 171,40	4,31 180,39	7,36 132,06	12,51 101,41	26,39 117,85
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	-8,41 0,02	-9,91 0,01	-3,67 0,08	2,96 -0,04	36,52 27,53		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-5,24 3,19	1,37 11,29	0,13 3,88	6,50 3,50	29,59 20,60		
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	2,89 11,32	12,01 21,94	9,71 13,46	21,02 18,02	38,23 29,25		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	-2,97 -3,64	5,58 4,18	3,19 0,13				
MOGI DAS CRUZES Var. IPCA + 6% p.p.	-0,53 -1,20	0,10 -1,29	1,99 -1,07	5,58 0,38	13,40 3,18	25,59 4,21	
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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	-6,70	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	3,53	6,82	14,94	14,46
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,35	22,41
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

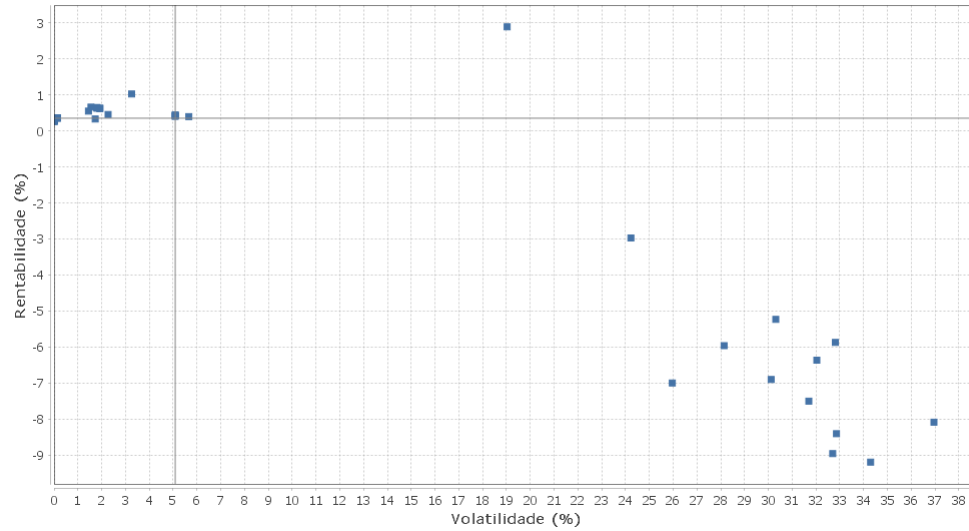
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
27	03/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.000,00	5,44162200	183,7687367000
21	04/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	497.658,83	2.707,60946200	183,8000779000
22	04/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.300.341,17	12.515,45268900	183,8000779000
24	04/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	764.000,00	0,00	4.156,69029500	183,8000779000
28	04/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	18.000,00	97,93249400	183,8000779000
25	07/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	764.000,00	4.154,67223800	183,8893555000
20	10/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.356.000,00	0,00	23.684,47177500	183,9179713000
26	10/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	404.000,00	0,00	2.196,63145100	183,9179713000
19	11/02/2020	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	678.000,00	0,00	231.204,88435660	2,9324640000
31	11/02/2020	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.358.000,00	0,00	2.993,70686443	453,6182270000
32	11/02/2020	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	678.000,00	0,00	1.621,51055950	418,1286369000
33	17/02/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	113.874,12	52.233,33734200	2,1801042360
34	17/02/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	405.203,16	187.880,60853700	2,1567055970
23	18/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.879.000,00	10.206,91000400	184,0909736000
29	18/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	10.000,00	54,32096900	184,0909736000
35	19/02/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	519.077,28	0,00	344.721,47950600	1,5057874570
30	20/02/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	29.000,00	157,48504800	184,1444656000

Total

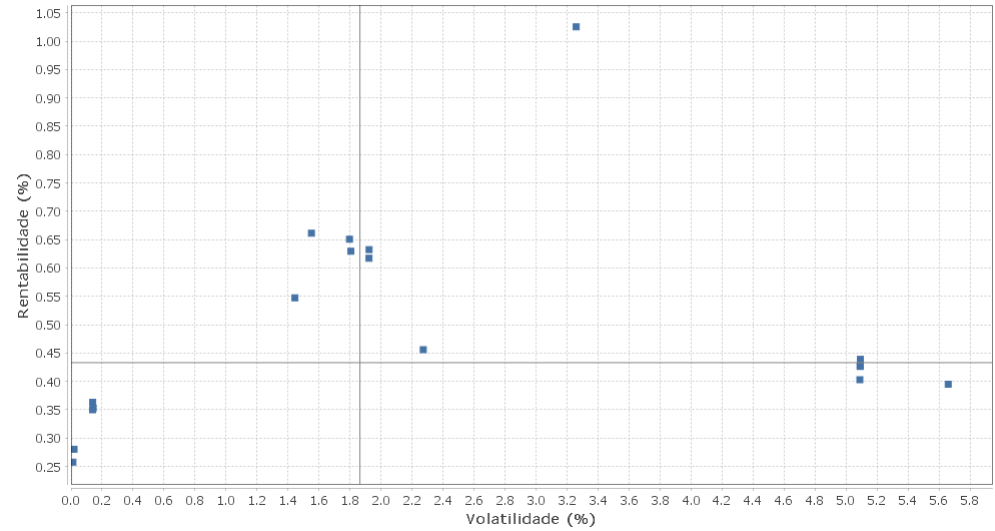
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

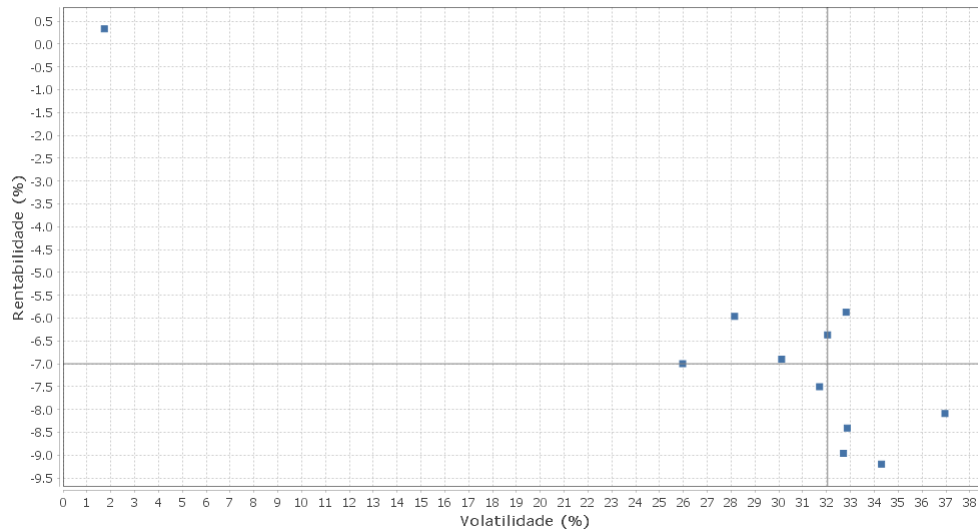
MOGI DAS CRUZES - No Mês



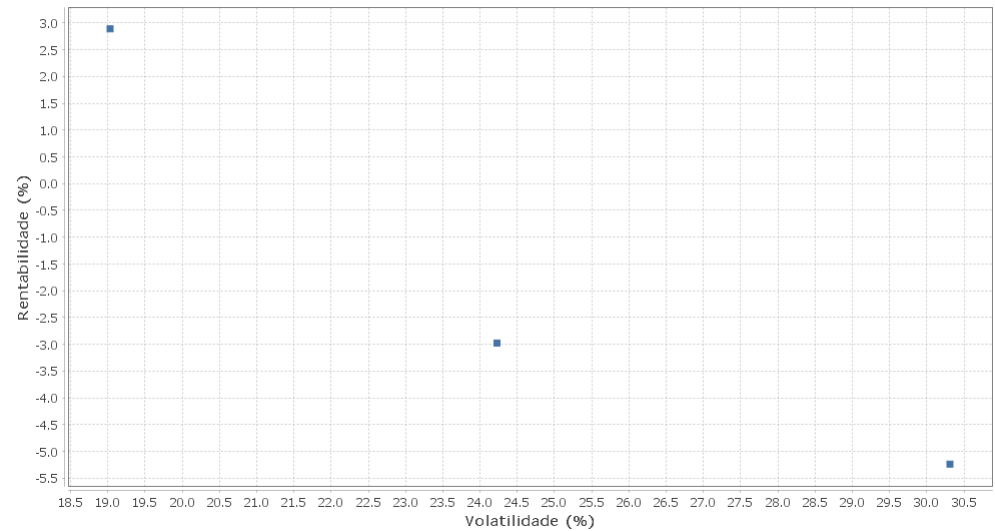
Renda Fixa - No Mês



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\$): 10.137.763,92

Value-At-Risk: 1,59%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-2,89	0,26	22.979.181,29	3,59
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,00	-0,68	0,28	6.704.554,88	1,05
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,09	0,00	0,40	0,35	15.014,77	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,09	0,00	0,50	0,36	77.038,77	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,09	0,00	0,41	0,35	60.156,36	0,01
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	0,75	0,00	0,18	0,55	4.380.722,86	0,69
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,90	0,01	0,24	0,66	15.771.189,60	2,47
BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	1,73	0,66	0,00	0,02	0,33	3.347.984,14	0,52
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,95	0,01	0,20	0,65	12.779.607,17	2,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,93	0,12	0,19	0,63	109.132.831,58	17,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,99	0,08	0,17	0,62	64.142.042,50	10,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,99	0,12	0,18	0,63	104.569.001,47	16,35
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	1,04	0,07	0,07	0,46	55.003.615,90	8,60
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,26	1,42	0,00	0,22	1,03	2.384.831,16	0,37
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,09	2,27	0,00	0,02	0,40	1.575.997,37	0,25
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	2,26	0,06	0,03	0,43	20.109.245,20	3,14
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	2,26	0,04	0,03	0,43	14.052.775,14	2,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	2,29	0,33	0,03	0,44	109.229.106,97	17,08
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	5,66	2,51	0,02	0,02	0,40	5.851.257,60	0,91
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,03	7,20	0,00	0,14	2,89	945.478,92	0,15
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,23	9,46	0,01	-0,13	-2,97	1.791.888,91	0,28
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,96	7,39	0,01	-0,28	-7,00	864.483,61	0,14
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,14	7,46	0,04	-0,22	-5,96	4.021.318,55	0,63
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	30,12	6,92	0,13	-0,24	-6,90	15.979.534,51	2,50
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	30,31	6,56	0,02	-0,18	-5,24	4.608.212,67	0,72
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	31,70	4,98	0,05	-0,25	-7,50	10.890.406,56	1,70
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	8,19	0,11	-0,21	-6,37	11.087.923,19	1,73
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,70	8,27	0,02	-0,28	-8,96	2.006.064,85	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,82	8,70	0,21	-0,19	-5,87	19.692.852,40	3,08
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	32,86	12,49	-0,00	-0,26	-8,41	3.810.388,88	0,60
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	34,30	7,50	0,04	-0,28	-9,20	4.522.150,65	0,71
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	36,96	8,87	0,07	-0,23	-8,09	7.106.802,85	1,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de fevereiro de 2020, vale observar que o Instituto está com 16,81% 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