



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
1º TRIMESTRE 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 31.03.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 92,86%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,16	-0,14	-7,10	-6,46	55.377.926,40	16,18	5.890.819.394,91	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,05	0,59	1,38	36.642.163,66	10,71	10.517.651.272,61	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,58	0,31	-1,80	-0,64	26.484.017,46	7,74	9.363.308.744,85	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16,90	-0,53	-10,91	-10,68	5.875.467,39	1,72	1.935.373.241,51	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,65	0,32	-1,45	-0,41	30.706.125,63	8,97	8.199.299.170,30	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	0,15	-0,11	1,36	46.646.784,37	13,63	15.907.113.181,36	0,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5,33	0,03	-2,10	-1,35	19.618.498,25	5,73	10.536.452.770,12	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,32	0,15	-0,13	1,31	61.644.147,69	18,01	11.020.077.699,37	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,17	0,32	-2,69	-1,23	8.780.868,00	2,57	169.094.624,07	5,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,61	0,10	-2,15	-1,11	291.775.998,85	85,25		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,17	0,03	0,35	1,04	15.142.270,74	4,42	4.026.737.305,82	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,01	0,14	0,79	10.886.065,89	3,18	5.503.080.783,31	0,20
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,19	0,02	0,27	0,93	26.028.336,63	7,61		
Renda Fixa			9,84	0,09	-1,95	-0,95	317.804.335,48	92,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

6,96%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	51,66	-8,44	-41,14	-47,27	1.054.674,87	0,31	416.036.779,10	0,25
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	41,23	-1,84	-30,69	-36,11	3.392.068,94	0,99	777.057.191,68	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	42,01	-5,51	-31,23	-38,06	1.019.368,84	0,30	544.828.665,14	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	35,44	-1,00	-27,40	-30,98	2.895.294,43	0,85	668.247.605,13	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	43,23	-3,88	-35,06	-41,61	1.167.878,22	0,34	894.019.781,17	0,13
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	38,15	-2,96	-31,06	-36,89	1.389.867,37	0,41	1.171.296.538,03	0,12
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	38,94	-3,44	-32,44	-39,18	3.024.428,36	0,88	2.717.755.336,40	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,87	-3,55	-31,94	-35,94	2.021.066,54	0,59	590.532.828,22	0,34
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			74,37	-3,16	-31,90	-37,30	15.964.647,57	4,66		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,25	-0,64	-5,31	-6,10	4.346.463,23	1,27	4.401.772.920,54	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,84	0,06	0,57	1,16	3.507.724,14	1,02	504.709.364,08	0,69
Sub-total Artigo 8º III			7,76	-0,33	-2,77	-3,12	7.854.187,37	2,29		
Renda Variável			53,98	-2,25	-24,25	-29,68	23.818.834,94	6,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,18%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,76	0,20	6,30	6,80	619.395,26	0,18	876.229.505,18	0,07
Sub-total Artigo 9º III			23,76	0,20	6,30	6,80	619.395,26	0,18		
Investimentos no Exterior			40,68	0,20	6,30	5,31	619.395,26	0,18		
Total			12,46	-0,07	-3,86	-3,50	342.242.565,68	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	291.775.998,85	85,25	50,00	73,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	26.028.336,63	7,61	0,00	10,00	40,00	0,00	50,00
	Total Renda Fixa	317.804.335,48	92,86					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	15.964.647,57	4,66	0,00	8,00	15,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	7.854.187,37	2,29	0,00	5,00	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	23.818.834,94	6,96					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	619.395,26	0,18	0,00	0,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	619.395,26	0,18					10,00
Total		342.242.565,68	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-2,15 -630,56	-1,11 -108,99	-1,11 -108,99			-6.472.778,37	-3.334.976,52
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,27 78,05	0,93 91,75	0,93 91,75			68.947,21	256.014,73
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-31,90 -2,00	-37,30 -0,44	-37,30 -0,44			-7.209.136,49	-9.195.473,60
Artigo 8º III % do CDI	-2,77 -814,41	-3,12 -307,01	-3,12 -307,01			-223.868,00	-241.206,79
Artigo 9º III % do CDI	6,30 1.852,52	6,80 669,58	6,80 669,58			36.730,44	39.416,05
TOLEDO (Total)						-13.800.105,21	-12.476.226,13

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.039.580,02	0,00	0,00	0,00	19.618.498,25	-421.081,77	-381.501,75
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.024.036,00	0,00	0,00	0,00	8.780.868,00	-243.168,00	-106.382,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.159.082,54	0,00	0,00	0,00	30.706.125,63	-452.956,91	-125.720,25
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.968.678,29	0,00	0,00	0,00	26.484.017,46	-484.660,83	-170.913,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.594.876,81	0,00	0,00	0,00	5.875.467,39	-719.409,42	-702.783,92
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	57.946.047,99	1.669.870,37	0,00	0,00	55.377.926,40	-4.237.991,96	-3.842.809,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.491.358,54	2.032.037,49	-5.106.732,18	0,00	36.642.163,66	225.499,81	635.785,43
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.205.134,64	1.500.000,00	0,00	0,00	46.646.784,37	-58.350,27	598.881,82
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.724.806,71	0,00	0,00	0,00	61.644.147,69	-80.659,02	760.468,74
					291.775.998,85	0,00	0,00

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.870.603,64	0,00	0,00	0,00	10.886.065,89	15.462,25	100.663,08
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.088.785,78	0,00	0,00	0,00	15.142.270,74	53.484,96	155.351,65
					26.028.336,63	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.893.703,37	0,00	0,00	0,00	3.392.068,94	-1.501.634,43	-1.937.171,67
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.791.739,51	0,00	0,00	0,00	1.054.674,87	-737.064,64	-945.325,13
FIA CAIXA CONSUMO	1.482.213,81	0,00	0,00	0,00	1.019.368,84	-462.844,97	-626.266,95
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.798.340,99	0,00	0,00	0,00	1.167.878,22	-630.462,77	-832.121,78
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.988.054,99	0,00	0,00	0,00	2.895.294,43	-1.092.760,56	-1.330.458,47
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	2.467.812,61	359.617,26	0,00	0,00	2.021.066,54	-806.363,33	-966.070,62
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.476.962,98	0,00	0,00	0,00	3.024.428,36	-1.452.534,62	-1.947.926,35
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	915.338,54	1.000.000,00	0,00	0,00	1.389.867,37	-525.471,17	-610.132,63
					15.964.647,57	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4.590.291,64	0,00	0,00	0,00	4.346.463,23	-243.828,41	-282.532,41
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	3.487.763,73	0,00	0,00	0,00	3.507.724,14	19.960,41	40.222,15
					7.854.187,37	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	582.664,82	0,00	0,00	0,00	619.395,26	36.730,44	39.416,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					619.395,26	0,00	0,00

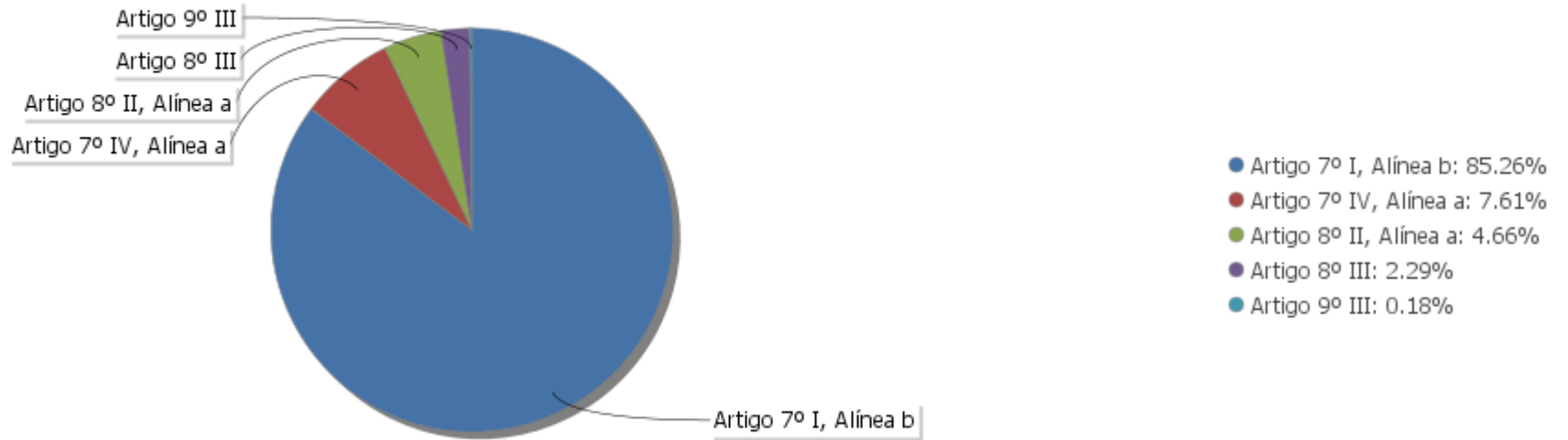
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

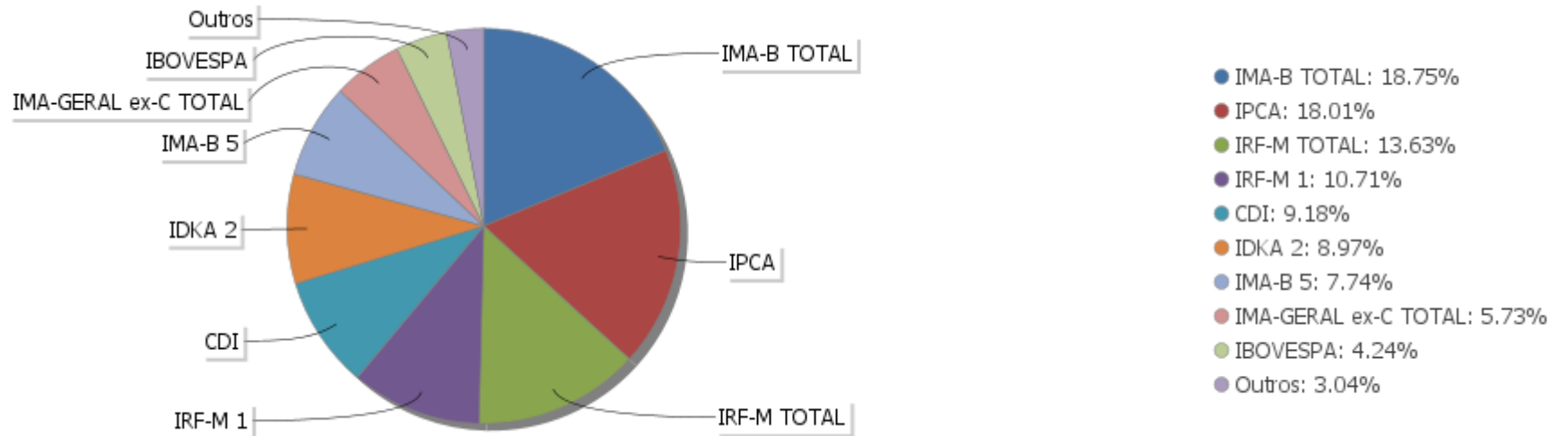
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	320.738.972,04	93,72	320.738.972,04	93,72	
de 31 dias a 365 dias	12.722.725,64	3,72	333.461.697,68	97,43	
acima de 365 dias	8.780.868,00	2,57	342.242.565,68	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

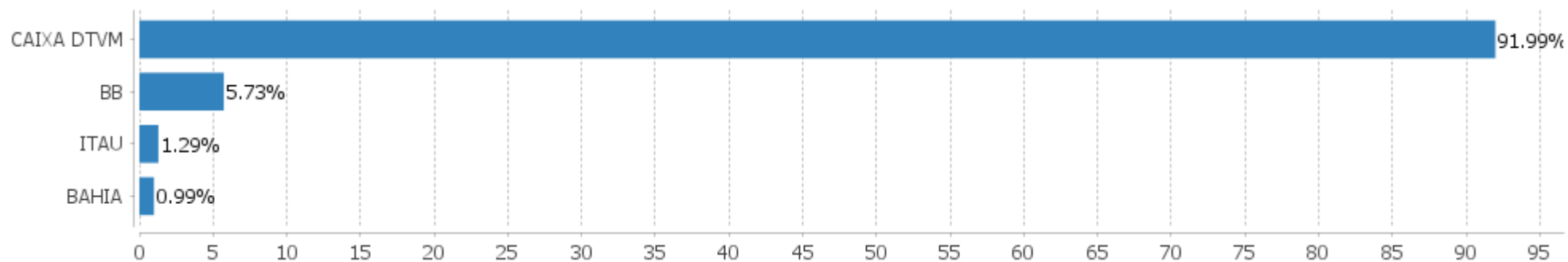


Alocação Por Estratégia



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	0,52	-0,14	-3,86										-3,50
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68										1,96
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54										-5,46

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	0	0,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	100,00

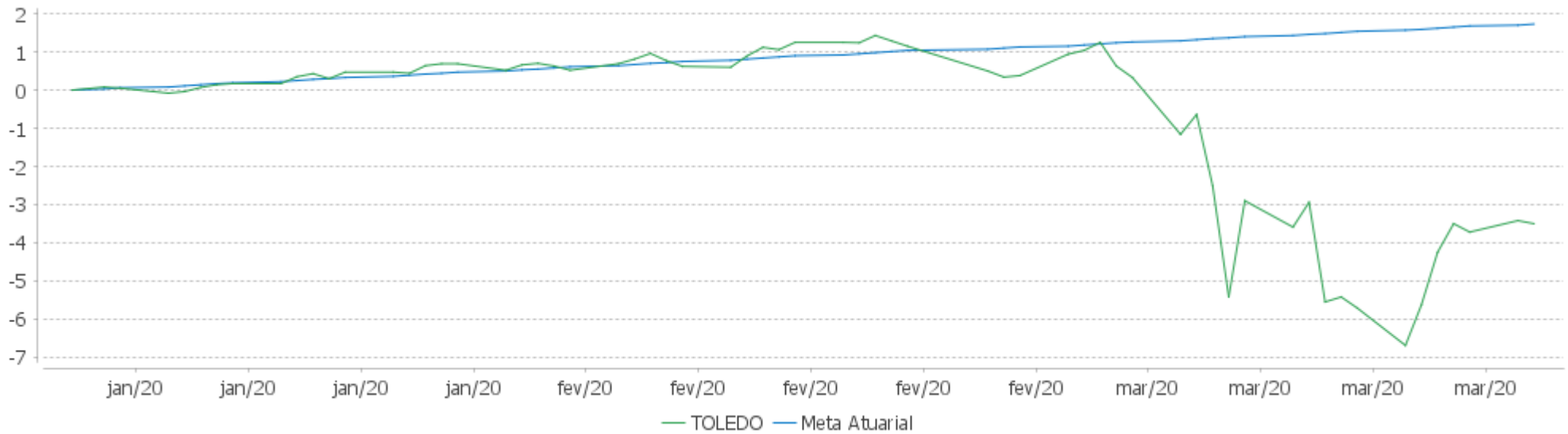
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,52	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

Relatório

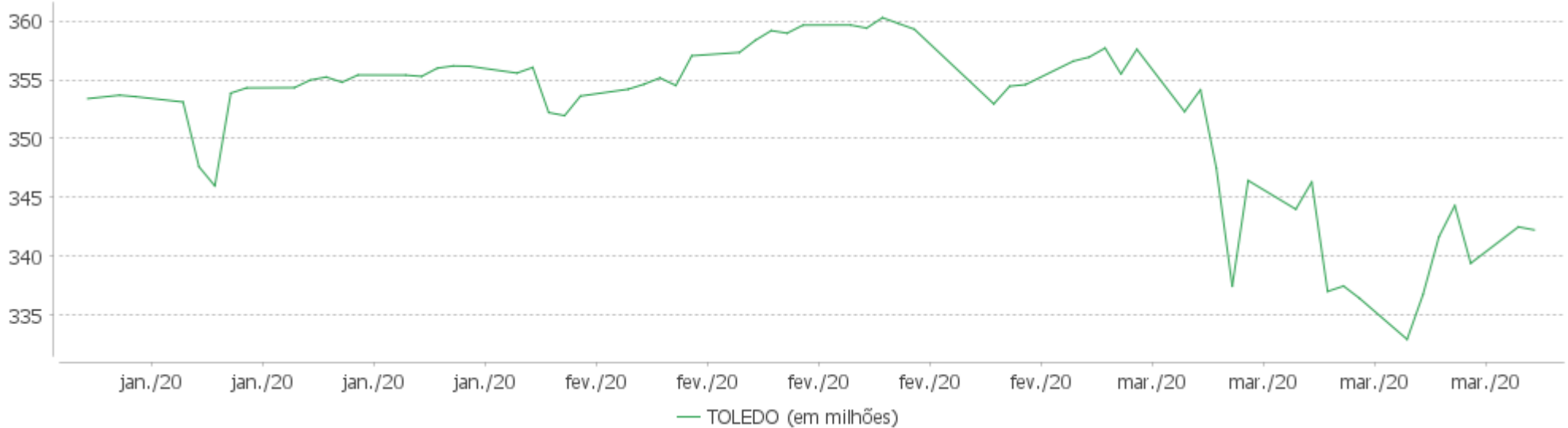
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-3,50	1,96	-5,46	12,46
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	-3,50	1,96	-5,46	12,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

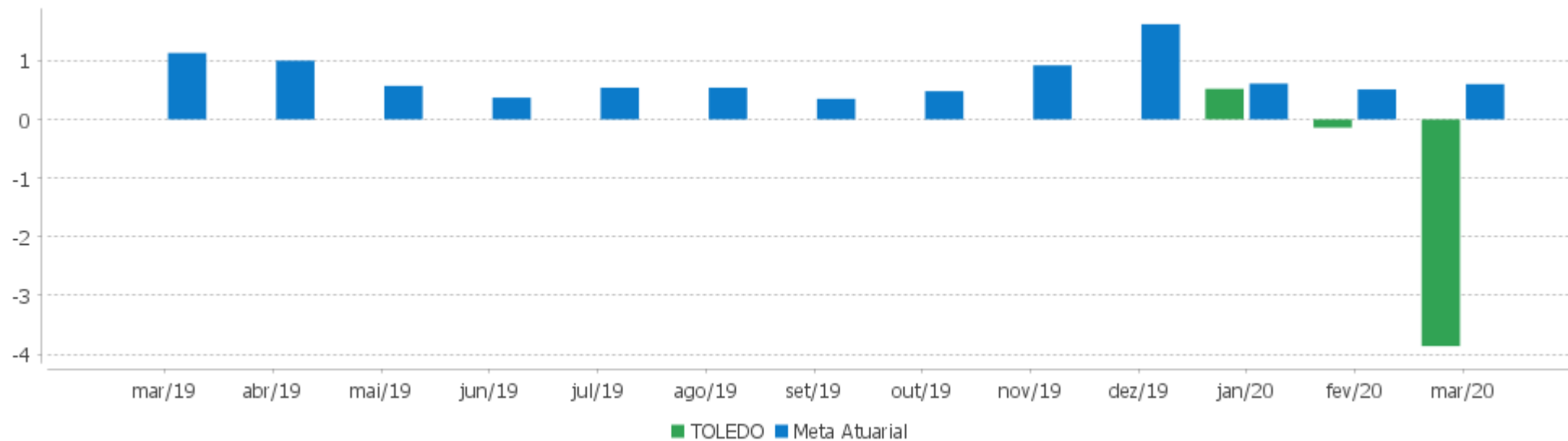


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,69 4,28	-1,23 5,08	-1,23 5,08	1,61 5,26	9,22 0,08		
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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 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 RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI 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
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 TÍTULOS PÚBLICOS 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
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 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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,91 0,02	-10,68 -0,07	-10,68 -0,07	-8,13 -0,22	7,75 -0,49	25,87 -1,08	38,51 -1,44
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,35 104,17	1,04 102,13	1,04 102,13	2,25 99,22	5,47 100,40	11,89 98,01	21,15 98,04
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 41,80	0,79 77,72	0,79 77,72	1,91 84,17	4,99 91,58	11,48 94,60	20,75 96,21
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,57 30,48	1,16 38,02	1,16 38,02	2,71 33,00	7,54 31,01		
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-5,31 -1.560,99	-6,10 -601,34	-6,10 -601,34	-2,57 -113,08	6,44 118,21	17,36 143,04	30,99 143,68
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-31,23 0,29	-36,04 0,06	-36,04 0,06	-29,74 0,58	-6,29 0,69	-10,28 -2,65	10,48 -3,80
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-35,06 -5,15	-40,34 -3,49	-40,34 -3,49	-28,21 2,08	-13,79 9,68	-6,52 7,94	25,26 12,89
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-31,06 -1,15	-34,96 1,90	-34,96 1,90	-26,97 3,32	-16,95 6,52	-1,94 12,52	28,49 16,13
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-30,69	-36,11	-36,11	-28,12	-21,54	-9,49	19,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,78	0,75	0,75	2,17	1,93	4,98	7,07
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	-41,14 -12.088,90	-45,49 -4.482,25	-45,49 -4.482,25	-31,86 -1.402,84	-9,18 -168,49	-2,76 -22,78	4,20 19,46
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-32,44 -2,54	-39,18 -2,32	-39,18 -2,32	-31,38 -1,09	-17,47 6,00	-4,42 10,04	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-27,40 -1,87	-30,98 0,25	-30,98 0,25	-22,11 -0,69	-12,36 -4,59	1,73 -3,15	28,59 1,41
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-31,94 -2,03	-35,94 0,91	-35,94 0,91	-26,62 3,67			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,30 0,83	6,80 0,91	6,80 0,91	12,71 0,63	27,06 0,32	62,46 -2,26	91,78 -5,68
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	-3,86 -4,54	-3,50 -5,46	-3,50 -5,46				
CDI	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,57
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6,00%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6,00%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du	0,00	1,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	2,50
					O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA DE UM DIA, APURADO PELA B3	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42	41,93	62,38
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11	76,79	99,92
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85	65,65	87,72
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68	52,54	77,77
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94	76,43	104,25
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42	67,06	93,09
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60	56,39	78,66
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92	52,76	79,20
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21	100,97	132,56
CDI	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,57	38,30	57,27

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37	45,88	42,76
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05	49,29	45,52
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61	39,23	35,25
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66	88,86	66,81
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29	26,41	24,09
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17	97,28	80,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,10	3,18	3,18	8,39	21,65	53,08	79,49	83,30	102,55

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69	67,87	85,07

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,31	0,93	0,93	6,06	16,05	36,88	61,70	62,25	68,76

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93	16,00	26,88
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82	14,84	26,21
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,81	15,64	15,87	21,49	35,53
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,59	38,34	57,35

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68	35,61	54,23
IPCA + 5,00%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29	40,88	61,75
IPCA + 5,50%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12	43,58	65,62
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55	45,70	68,69
IPCA + 6,00%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96	46,31	69,56
INPC + 4,00%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44	34,26	53,42
INPC + 6,00%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65	44,85	68,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	07/01 /2020	FUNDO INVESTIMENTO COTAS FUNDO INVESTIMENTO CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II MULTIMERCADO	0,00	5.645.635,79	4.978.260,18598696	1,1340580000
2	08/01 /2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.000.000,00	792.267,15478300	2,5244010000
3	09/01 /2020	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	2.000.000,00	0,00	835.253,72084600	2,3944820000
4	09/01 /2020	FIA CAIXA CONSUMO	1.645.635,79	0,00	747.410,18646600	2,2017840000
5	09/01 /2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.000.000,00	0,00	974.113,42284400	2,0531490000
6	09/01 /2020	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	2.000.000,00	0,00	630.827,72451261	3,1704377000
7	10/01 /2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	341.970,10	0,00	272.391,50382800	1,2554360000
8	14/01 /2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.958.597,81653100	2,5261470000
9	14/01 /2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	10.000.000,00	0,00	6.866.296,52027600	1,4563891860
10	29/01 /2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.000.000,00	818.878,98274400	3,6635450000
11	29/01 /2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	987.463,45	390.037,67365800	2,5317130000
12	31/01 /2020	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	2.032.037,49	0,00	940.233,13372256	2,1612060000
13	07/02 /2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.074.394,09	0,00	838.275,11149200	3,6675240000
14	10/02 /2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	359.617,26	0,00	250.649,95096600	1,4347390000
15	17/02 /2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.940.686,36607600	2,5376290000
16	17/02 /2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	10.000.000,00	0,00	6.788.567,88956200	1,4730647410
17	18/02 /2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000.000,00	394.005,13231700	2,5380380000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
18	18/02/2020	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1.000.000,00	0,00	34.881,50230445	28,6684900000
19	19/02/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	215.271,28	0,00	149.282,97856800	1,4420350000
20	26/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	925.389,71	364.370,84219300	2,5396920000
21	26/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.100.000,00	843.817,76992900	3,6737790000
22	27/02/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	41.882,68	0,00	29.089,31543000	1,4397960000
23	27/02/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.032.037,49	0,00	1.411.337,08525300	1,4397960000
24	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.500.000,00	0,00	665.561,53870700	2,2537360000
25	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.669.870,37	0,00	474.951,17009100	3,5158780000
26	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000.000,00	392.809,07994400	2,5457660000
27	10/03/2020	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1.000.000,00	0,00	41.942,61587455	23,8420990000
28	12/03/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	359.617,26	0,00	431.340,05260000	0,8337210000
29	27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.106.732,18	1.607.917,47694000	2,5540690000
30	30/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.032.037,49	0,00	795.317,68872100	2,5550010000
Total			43.304.371,30	41.765.221,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.850.730,25

Value-At-Risk: 3,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		3,17	3,17			342.242.565,68	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,09%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,07	0,63	0,04			55.377.926,40	16,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,01	0,00			36.642.163,66	10,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,92	0,14	0,02			26.484.017,46	7,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		7,89	0,13	0,23			5.875.467,39	1,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,67	0,13	0,33			30.706.125,63	8,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,13	0,27	0,01			46.646.784,37	13,63
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		2,05	0,11	0,26			19.618.498,25	5,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,13	0,36	2,13			61.644.147,69	18,01
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,27	0,08	1,58			8.780.868,00	2,57
Sub-total	17,84	2,27	1,86		-0,14	-2,15	291.775.998,85	85,25

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,08	0,00	0,08			15.142.270,74	4,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,05			10.886.065,89	3,18
Sub-total	0,32	0,06	0,00		-0,24	0,27	26.028.336,63	7,61

Renda Variável

Value-At-Risk: 19,97%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		33,80	0,09	33,80			1.054.674,87	0,31
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		29,37	0,27	3,16			3.392.068,94	0,99
FIA CAIXA CONSUMO		27,92	0,07	0,39			1.019.368,84	0,30
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		27,84	0,22	4,80			2.895.294,43	0,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		28,27	0,09	8,50			1.167.878,22	0,34
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI		27,29	0,10	6,44			1.389.867,37	0,41
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		28,34	0,23	5,60			3.024.428,36	0,88
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		28,68	0,14	14,50			2.021.066,54	0,59
Sub-total	120,98	28,10	1,21		-0,27	-31,90	15.964.647,57	4,66

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		6,23	0,07	6,23			4.346.463,23	1,27
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO		0,23	0,00	31,51			3.507.724,14	1,02
Sub-total	12,38	3,50	0,07		-0,25	-2,77	7.854.187,37	2,29

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 17,36%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		17,36	0,02	0,58			619.395,26	0,18
Sub-total	62,09	17,36	0,02		0,10	6,30	619.395,26	0,18