LDB
EMPRESAS

UBATUBA

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 14.05.2020.

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.

LDB CONSULTORIA

Carteira: UBATUBA | Data Extrato: 30/04/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **99,55%**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,54	0,72	-0,47	41.933.812,23	10,66
TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	3,15	-1,83	-1,26	19.425.930,23	4,94
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**6,19**	**-0,10**	**-0,72**	**61.359.742,46**	**15,60**

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	12,33	1,30	-5,25	56.882.416,28	14,46	5.880.207.997,15	0,97
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	18,74	1,92	-8,86	15.441.493,74	3,93	1.959.264.029,83	0,79
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	18,85	1,95	-8,95	11.972.371,63	3,04	1.937.305.372,80	0,62
BB	BB	BB Previdenciario XI Títulos Públicos	5,03	0,46	0,06	6.429.204,65	1,63	192.891.147,13	3,33
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	6,01	0,91	-0,28	60.836.662,23	15,47	10.512.346.440,60	0,58
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	6,00	1,11	2,43	68.535.579,30	17,42	11.368.843.034,79	0,60
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**9,68**	**1,07**	**-2,77**	**220.097.727,83**	**55,95**		

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,98	0,14	1,28	63.318.239,52	16,10	5.079.848.328,78	1,25
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	2,13	0,44	1,15	30.200.560,02	7,68	871.769.858,12	3,46
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,56	1,02	-0,30	16.617.910,83	4,22	1.194.562.049,15	1,39
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	**2,26**	**0,35**	**0,90**	**110.136.710,37**	**28,00**		
		Renda Fixa	**7,26**	**0,66**	**-1,67**	**391.594.180,66**	**99,55**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 0,45%

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	FIA INFRAESTRUTURA	44,78	10,49	-8,42	831.675,93	0,21	369.805.422,58	0,22
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	45,48	11,33	-26,26	936.824,60	0,24	965.556.817,86	0,10
		Sub-total Artigo 8º II, Alínea a	**105,94**	**10,97**	**-24,44**	**1.768.500,53**	**0,45**		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	**105,94**	**10,97**	**-24,44**	**1.768.500,53**	**0,45**		
		Total				**393.362.681,19**	**100,00**		

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**Limite Legal**
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	61.359.742,46	15,60	15,00	15,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	220.097.727,83	55,95	0,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	110.136.710,37	28,00	0,00	20,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	**391.594.180,66**	**99,55**				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	1.768.500,53	0,45	0,00	5,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	**1.768.500,53**	**0,45**				

Rentabilidades por Artigo

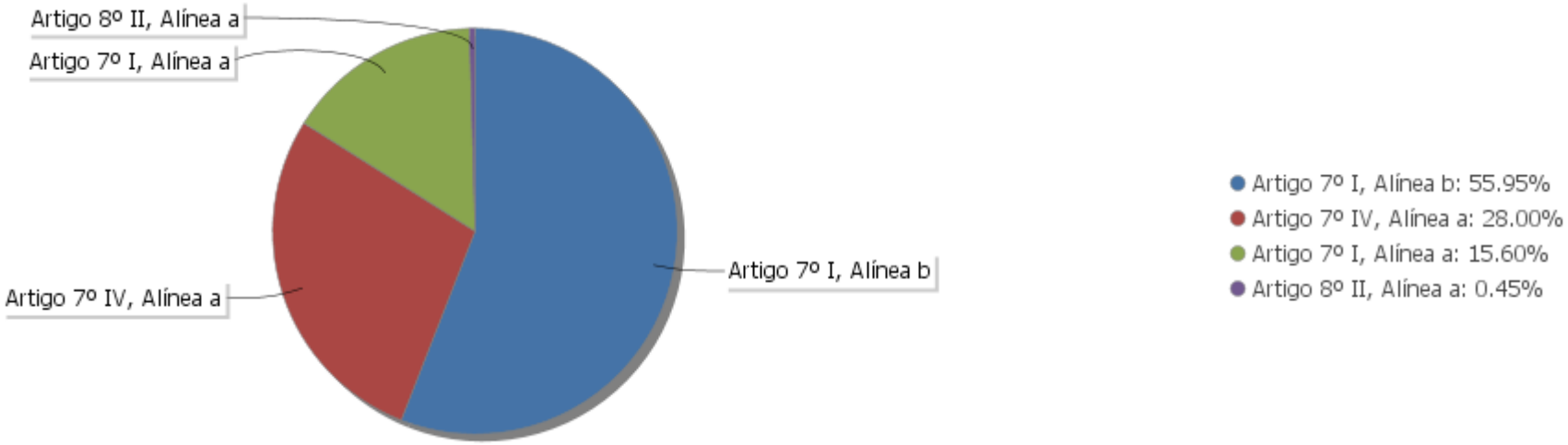
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-0,10 -36,39	-0,72 -55,22	-1,43 -155,65	0,44 21,47	9,28 178,65	-63.682,88	-429.681,66
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,07 375,38	-2,77 -212,75	-3,17 -344,50	-3,06 -148,20	8,47 163,09	2.232.826,66	-7.169.464,31
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,35 121,16	0,90 69,25	0,54 58,98	1,37 66,24	8,82 169,92	372.369,12	889.903,15
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,97 0,72	-24,44 -3,19				163.574,56	-61.499,47
						2.705.087,46	-6.770.742,29

Análise de Liquidez

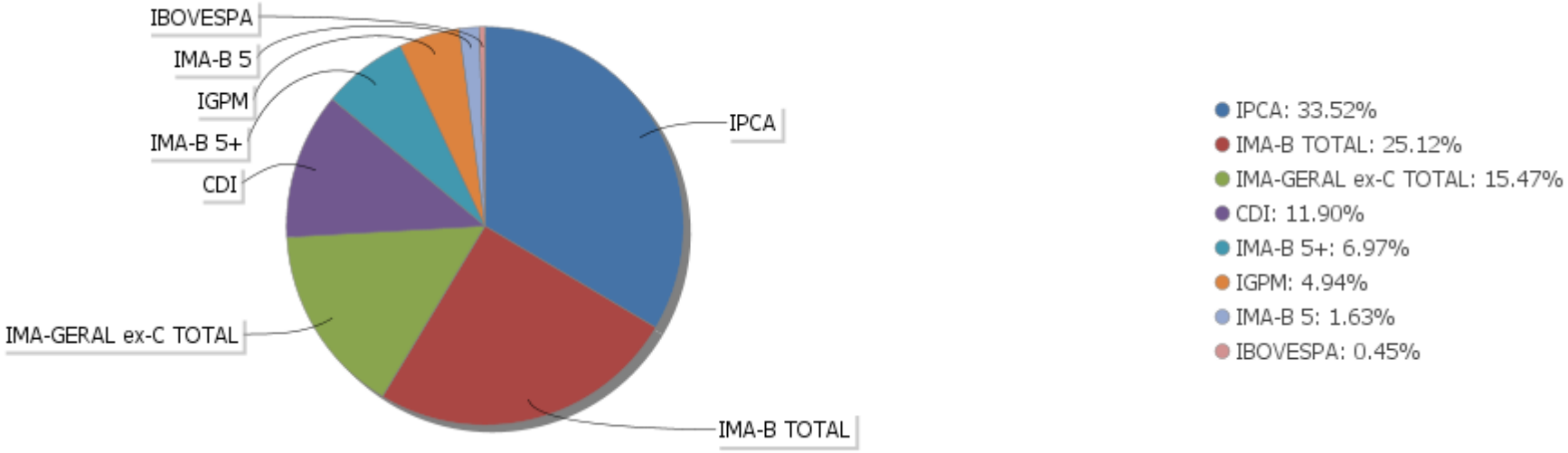
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	325.573.734,08	82,77	325.573.734,08	82,77
de 31 a 364 dias	19.425.930,23	4,94	344.999.664,31	87,71
acima de 365 dias	48.363.016,88	12,29	393.362.681,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

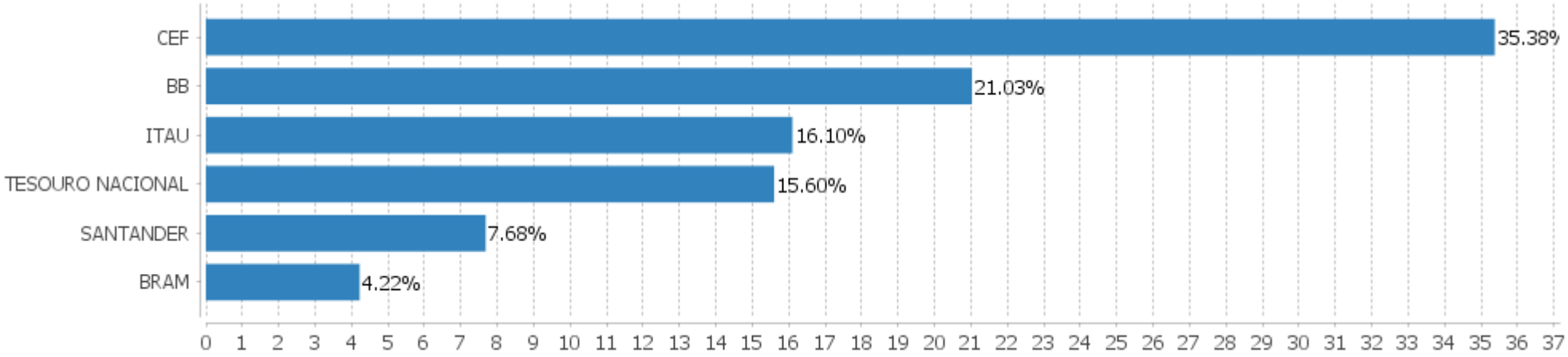


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,45	0,43	-3,22	0,70									-1,68
INPC + 5,86%	0,69	0,58	0,68	0,22									2,19
p.p. indexador	-0,24	-0,15	-3,90	0,47									-3,87
2019	2,36	0,52	0,65	1,13	2,41	2,83	1,13	-0,16	2,06	2,14	-1,26	1,28	16,10
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,49	-0,49	-0,56	0,04	1,75	2,38	0,50	-0,79	1,63	1,57	-2,26	-0,43	5,33
2018	1,76	0,58	1,28	0,26	-1,66	0,28	1,46	-0,26	0,54	3,44	0,39	1,30	9,72
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,02	-0,02	0,72	-0,43	-2,58	-1,64	0,70	-0,79	-0,20	2,53	0,18	0,70	0,13
2017	1,66	2,15	1,20	0,17	-0,47	0,45	2,55	1,13	1,23	0,17	-0,14	0,83	11,43
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,73	1,50	0,34	-0,33	-1,35	0,26	1,89	0,63	0,79	-0,69	-0,78	0,10	3,31

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

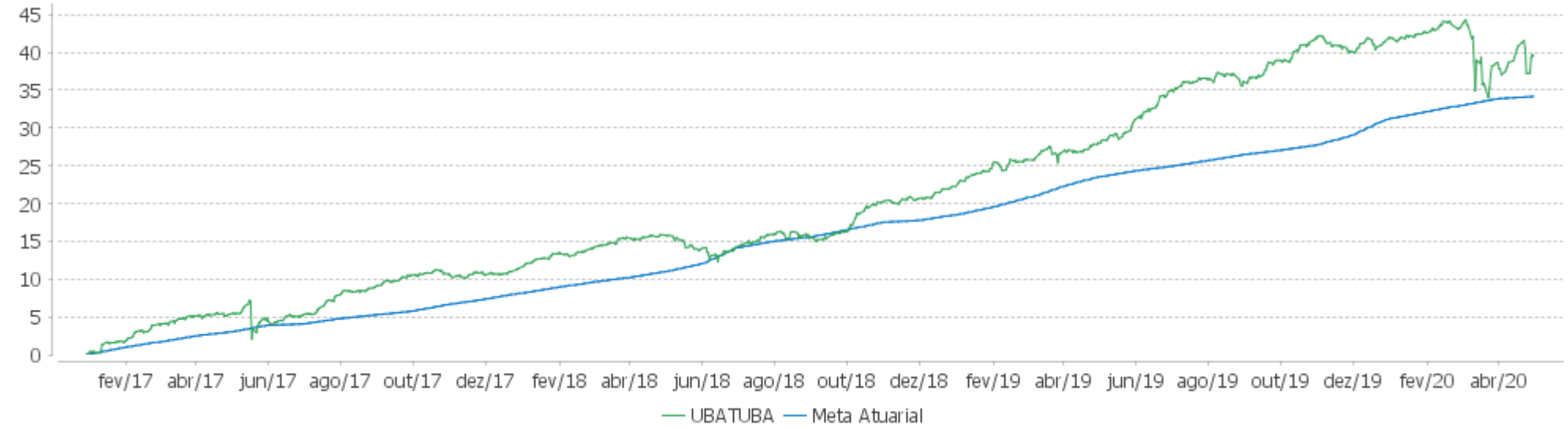
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima da Meta Atuarial	22	55,00
Meses abaixo da Meta Atuarial	18	45,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,44	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-3,22	2020-03

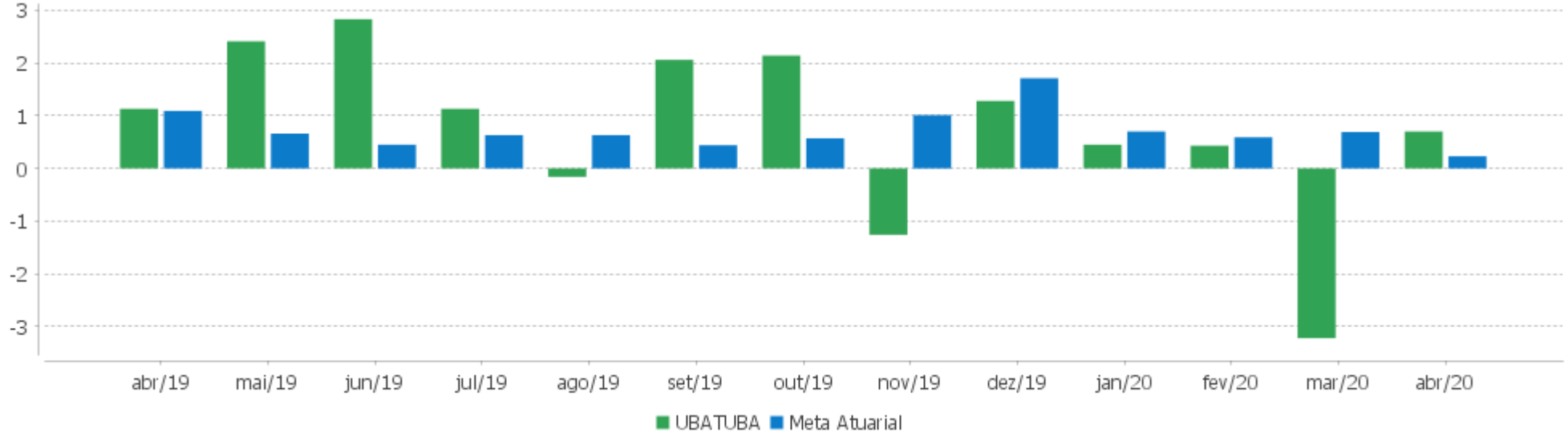
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-2,12	1,49	-3,61	14,10
06 meses	-1,68	4,98	-6,66	9,99
12 meses	8,99	8,59	0,40	7,31
24 meses	20,50	20,89	-0,39	5,71
36 meses	32,57	30,25	2,32	5,63
Desde 30/12/2016	39,55	34,12	5,43	5,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	1,30	-5,25	-5,48	-5,82	8,47	25,17	38,56
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,17	-0,15	-0,27	-0,47	-0,75	-1,12
BB Previdenciario XI Títulos Públicos	0,46	0,06	-0,57	0,85	9,20	20,63	35,81
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,03	0,15	0,07	-0,01	0,53	1,16	2,43
BB PREV ALOC FIC	0,91	-0,28	-0,76	-0,26	8,60	19,45	31,58
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,07	-0,10	-0,09	-0,29	0,26	0,41	-0,29
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,11	2,43	1,60	2,52	13,47	24,61	36,68
Var. IPCA p.p.	1,42	2,22	1,59	0,63	11,07	17,15	26,25
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	1,95	-8,95	-8,91	-10,50	7,94	29,14	42,37
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,07	-0,13	-0,06	-0,25	-0,53	-1,18	-1,57
BB PREV IMA-B5+	1,92	-8,86	-8,90	-10,22	8,35	29,79	42,72
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,10	-0,05	-0,06	0,03	-0,13	-0,53	-1,22
SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	0,44	1,15	0,80	1,75	10,41	16,70	
% do CDI	156,05	88,40	87,47	84,49	200,58	140,74	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,14	1,28	0,93	1,98	9,19	18,37	30,21
Var. IPCA p.p.	0,45	1,06	0,92	0,09	6,79	10,91	19,78
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,02	-0,30	-0,73	-0,40	8,12	18,37	
% do CDI	359,05	-23,04	-78,84	-19,23	156,46	154,80	
NTN-B 150824	0,72	-0,47	-1,28	0,05	11,62	24,39	40,09
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,60	4,61	4,04	5,60	2,68	-1,53	0,41
NTN-C 010421	-1,83	-1,26	-1,77	1,32	7,25	21,61	36,67
Var. IGPM p.p.	-2,63	-3,76	-3,78	-3,63	0,56	5,69	18,55
FIA INFRAESTRUTURA	10,49	-29,74	-30,52	-20,71	-4,10	12,34	34,56
Var. IBOVESPA p.p.	0,24	0,64	-1,29	4,20	12,35	18,86	11,47
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	11,33	-33,59	-33,92	-21,69	-5,18	2,17	34,95
Var. IBOVESPA p.p.	1,08	-3,20	-4,69	3,23	11,27	8,68	11,86
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

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	4,95	6,69	15,93	18,12
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,00	1,51	0,95	3,86	6,51	16,21	24,16

Carteira: UBATUBA

Data Extrato: 30/04/2020

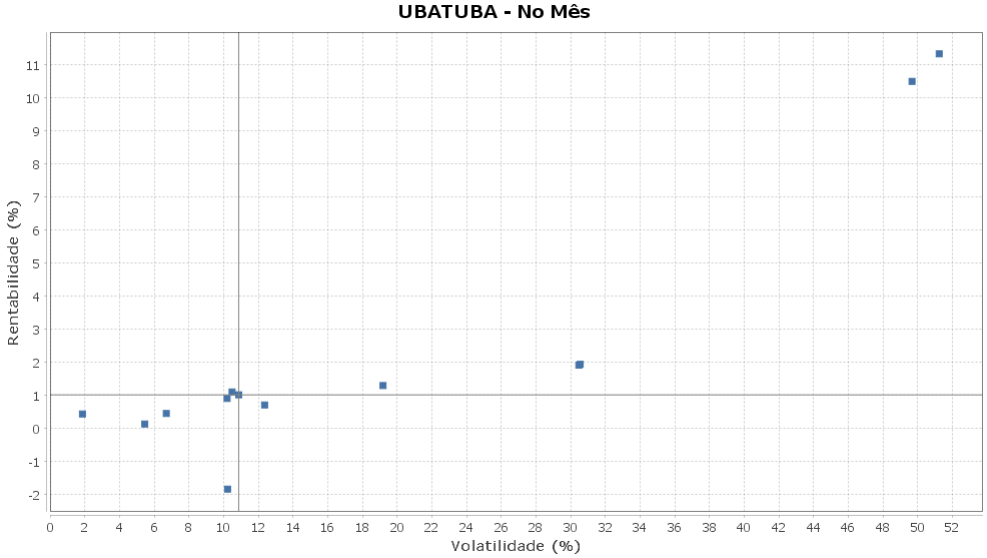
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

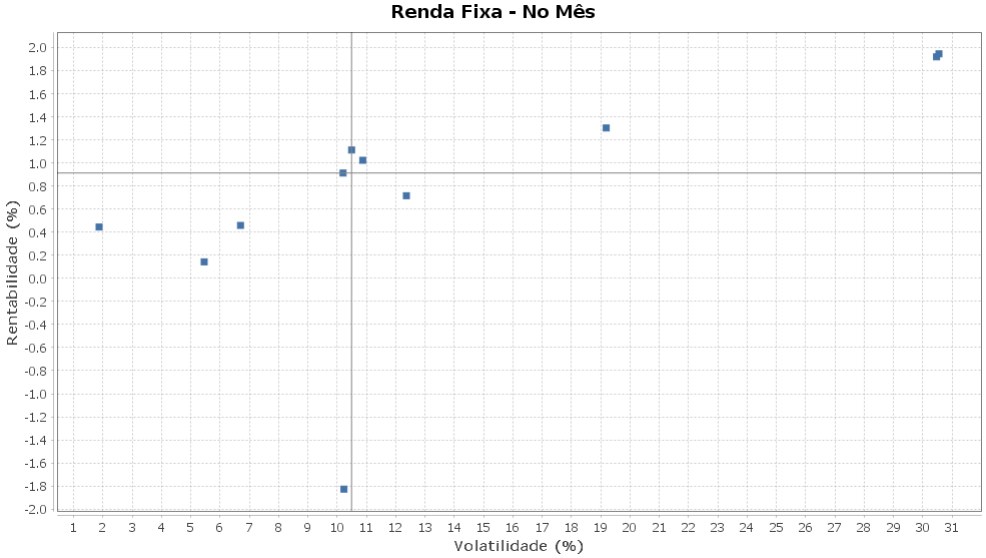
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,08	1,82	1,18	4,34	7,54	18,45	27,76
IPCA + 5,5%	0,11	1,98	1,29	4,59	8,05	19,58	29,59
IPCA + 5,89%	0,14	2,10	1,38	4,78	8,45	20,46	31,02
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43
INPC + 4%	0,08	1,60	1,06	4,05	6,57	16,43	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30

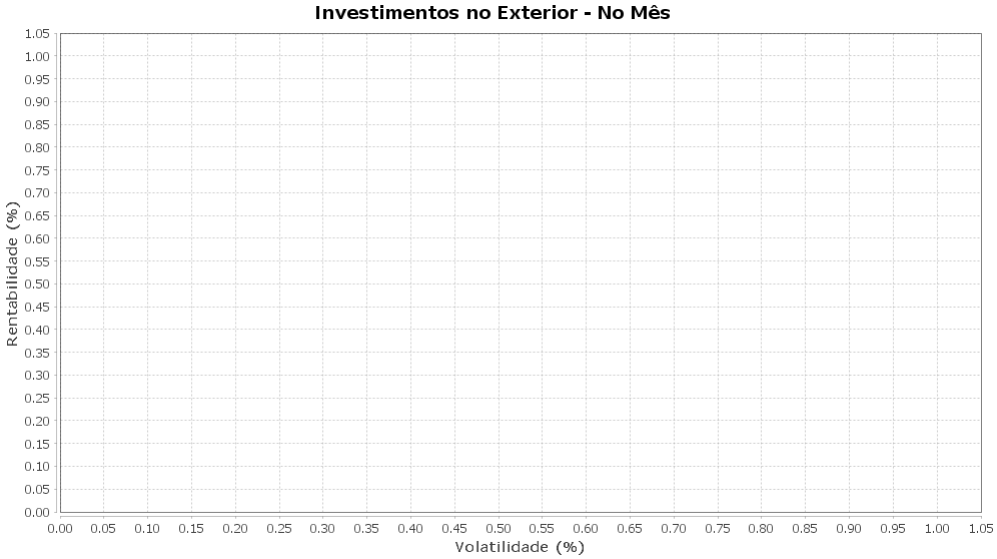
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
06/04/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	290.000,00	0,00	248.581,37182600	1,1666200000
06/04/2020	FIA INFRAESTRUTURA	250.000,00	0,00	197.838,18261000	1,2636590000
06/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	105.000,00	0,00	5.929,28129261	17,7087230000
08/04/2020	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	0,00	20.000.000,00	8.527.442,80426600	2,3453690000
08/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	0,00	10.000,00	795,11356300	12,5768198000
09/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	15.000.000,00	0,00	845.058,71073561	17,7502460000
13/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	5.000.000,00	0,00	397.157,48983200	12,5894642000
14/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	1.820.000,00	0,00	144.485,36132300	12,5964318000
15/04/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	100.000,00	0,00	77.535,36775800	1,2897340000
15/04/2020	FIA INFRAESTRUTURA	100.000,00	0,00	73.304,96919700	1,3641640000
15/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	70.000,00	0,00	5.554,80675900	12,6016985000
16/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	69.000,00	0,00	5.472,37844400	12,6087771000
22/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	0,00	1.736.444,41	137.525,46193400	12,6263485000
22/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	0,00	1.824.322,52	144.485,36132300	12,6263485000
22/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	0,00	70.136,92	5.554,80675900	12,6263485000
22/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	0,00	69.096,15	5.472,37844400	12,6263485000
28/04/2020	SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	200.000,00	0,00	15.857,22836700	12,6125446000

Risco - Dispersão







Carteira: UBATUBA

Data Extrato: 30/04/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
SANTANDER RF ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	Artigo 7º IV, Alínea a	1,87	0,22	0,44	30.200.560,02	7,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	5,46	0,57	0,14	63.318.239,52	16,10
BB Previdenciario XI Títulos Públicos	Artigo 7º I, Alínea b	6,70	0,72	0,46	6.429.204,65	1,63
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	1,10	0,91	60.836.662,23	15,47
NTN-C 010421	Artigo 7º I, Alínea a	10,23	0,97	-1,83	19.425.930,23	4,94
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,49	1,14	1,11	68.535.579,30	17,42
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	10,87	1,18	1,02	16.617.910,83	4,22
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	12,36	1,32	0,72	41.933.812,23	10,66
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	19,19	2,05	1,30	56.882.416,28	14,46
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	30,47	3,25	1,92	15.441.493,74	3,93
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	30,55	3,26	1,95	11.972.371,63	3,04
FIA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	49,68	5,65	10,49	831.675,93	0,21
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	51,24	5,85	11,33	936.824,60	0,24