



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
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 05.06.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

72,60%

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	4,90	0,41	0,66	2.418.422,61	0,45	201.918.437,08	1,20
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	1,97	0,63	1,17	2.960.413,22	0,55	1.660.772.359,14	0,18
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,89	0,43	0,68	3.322.172,52	0,61	385.487.147,46	0,86
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,44	0,70	44.150.097,23	8,16	6.284.654.664,10	0,70
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,44	0,69	66.523.085,60	12,30	6.609.422.706,56	1,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,04	0,44	0,93	13.450.474,28	2,49	1.445.830.540,62	0,93
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	0,63	1,18	11.679.183,76	2,16	9.698.235.388,71	0,12
BB	BB	BB PR IMA GERAL	2,03	0,43	0,91	4.405.168,12	0,81	679.279.368,47	0,65
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	2,09	0,63	1,48	24.079.986,31	4,45	15.973.064.296,15	0,15
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,65	1,21	23.459.023,96	4,34	4.537.919.668,21	0,52
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,61	0,72	1,41	3.160.682,08	0,58	283.031.462,08	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	1,19	0,41	0,61	781.268,28	0,14	676.748.275,25	0,12
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,33	0,46	0,94	63.494.071,90	11,74	10.908.803.618,87	0,58
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,44	0,62	1,44	7.559.744,77	1,40	10.626.779.468,55	0,07
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,45	0,65	1,00	1.147.920,88	0,21	1.658.382.741,96	0,07
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,80	0,25	0,21	3.198.860,49	0,59	994.853.758,21	0,32
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,82	0,55	0,97	1.327.491,76	0,25	880.076.235,05	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,53	1,85	5.622.948,00	1,04	189.103.390,31	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,36	0,53	1,86	2.800.850,00	0,52	214.238.662,28	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,40	0,49	0,96	285.541.865,77	52,80		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,05	0,27	0,63	15.695.875,64	2,90	6.862.974.437,90	0,23
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,36	0,70	0,91	12.547.128,85	2,32	354.676.028,50	3,54
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,17	0,17	2.485.782,40	0,46	5.421.482.050,58	0,05
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,19	0,47	1,04	6.303.993,92	1,17	966.760.070,45	0,65
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,27	0,62	4.176.979,19	0,77	2.774.667.818,45	0,15
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	5,44	0,55	0,92	19.337.977,05	3,58	891.690.665,15	2,17
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,69	0,26	0,60	24.640.134,31	4,56	5.092.614.949,01	0,48
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	2,01	1,07	2,03	2.888.276,06	0,53	763.937.010,15	0,38
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,66	0,59	0,75	10.587.422,14	1,96	834.144.361,75	1,27
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	2,75	0,77	1,43	6.401.395,19	1,18	83.185.382,92	7,70
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,85	0,51	0,90	105.064.964,75	19,43		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	INTRADER	PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	32,56	-0,08	-0,85	2.005.197,84	0,37	113.413.604,77	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			32,56	-0,08	-0,85	2.005.197,84	0,37		
Renda Fixa			3,22	0,50	0,94	392.612.028,36	72,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,72%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS	19,38	-8,42	-9,83	3.606.937,88	0,67	352.355.931,64	1,02
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	19,17	-8,30	-9,83	10.407.092,88	1,92	613.653.165,94	1,70
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			19,17	-8,33	-9,86	14.014.030,76	2,59		

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
BRAM	BEM	BRDESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	18,78	-8,16	-9,22	1.794.448,54	0,33	16.451.760,92	10,91
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	20,11	-11,06	-12,20	9.489.667,17	1,75	852.904.449,09	1,11
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	19,28	-8,85	-8,51	14.562.133,35	2,69	597.760.232,25	2,44
BB	BB	BB Ações Dividendos	17,97	-8,73	-9,11	7.781.296,44	1,44	1.122.348.597,47	0,69
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	18,63	-8,40	-10,89	8.797.673,83	1,63	2.400.993.535,41	0,37
BRAM	BEM	BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	18,32	-7,91	-6,42	20.674.978,31	3,82	2.341.977.575,47	0,88
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	18,20	-7,78	-7,15	3.391.064,56	0,63	830.830.920,01	0,41
CEF	CEF	FIA CONSTRUCAO CIVIL	24,54	-10,66	-13,75	2.633.954,85	0,49	974.243.337,57	0,27
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,63	-7,13	-5,24	7.409.171,76	1,37	1.938.091.271,83	0,38
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,71	-7,29	-7,83	3.049.746,59	0,56	1.139.056.064,38	0,27
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	17,82	-6,28	-8,43	2.867.747,19	0,53	1.103.978.172,66	0,26
CEF	CEF	FIA CONSUMO	19,60	-10,05	-13,45	2.647.507,45	0,49	903.356.588,09	0,29
VINCI	CEF	FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,49	-6,37	-4,94	2.258.110,52	0,42	909.648.393,83	0,25
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,36	-8,60	-8,14	11.884.073,58	2,20	1.542.999.030,98	0,77
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	20,37	-8,75	-9,36	1.496.086,34	0,28	3.615.715.347,19	0,04
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,26	-9,79	-9,96	9.554.869,56	1,77	4.106.559.997,95	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19,26	-9,27	-7,93	6.507.681,81	1,20	2.262.526.519,52	0,29
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,07	-8,67	-8,67	116.800.211,85	21,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	14,85	-7,44	-7,10	7.943.724,01	1,47	393.099.384,46	2,02
Sub-total Artigo 8º III			14,85	-7,44	-7,10	7.943.724,01	1,47		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GAVEA	GAVEA	GÁVEA INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE	66,08	-0,72	-1,31	914.006,92	0,17	20.384.112,51	4,48
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	23,56	-0,09	4,76	2.798.199,31	0,52	139.180.433,62	2,01
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			24,67	-0,25	3,20	3.712.206,23	0,69		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE	21,71	-2,65	-12,23	1.254.000,00	0,23	150.315.000,00	0,83
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	41,65	-5,01	-26,30	685.953,00	0,13	592.356.534,00	0,12
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	50,15	1,48	-32,99	91.120,54	0,02	15.667.387,54	0,58
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			33,40	-3,29	-18,58	2.031.073,54	0,38		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,29	-8,30	-8,55	144.501.246,39	26,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,68%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,34	-5,69	0,46	3.660.743,08	0,68	866.229.995,42	0,42
Sub-total Artigo 9º A, III			16,34	-5,69	0,46	3.660.743,08	0,68		
Investimentos no Exterior			16,34	-5,69	0,46	3.660.743,08	0,68		
Total						540.774.017,83	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	285.541.865,77	52,80	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	105.064.964,75	19,43	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.005.197,84	0,37	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	392.612.028,36	72,60				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	14.014.030,76	2,59	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	116.800.211,85	21,60	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	7.943.724,01	1,47	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.712.206,23	0,69	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.031.073,54	0,38	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	144.501.246,39	26,72				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	3.660.743,08	0,68	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	3.660.743,08	0,68				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

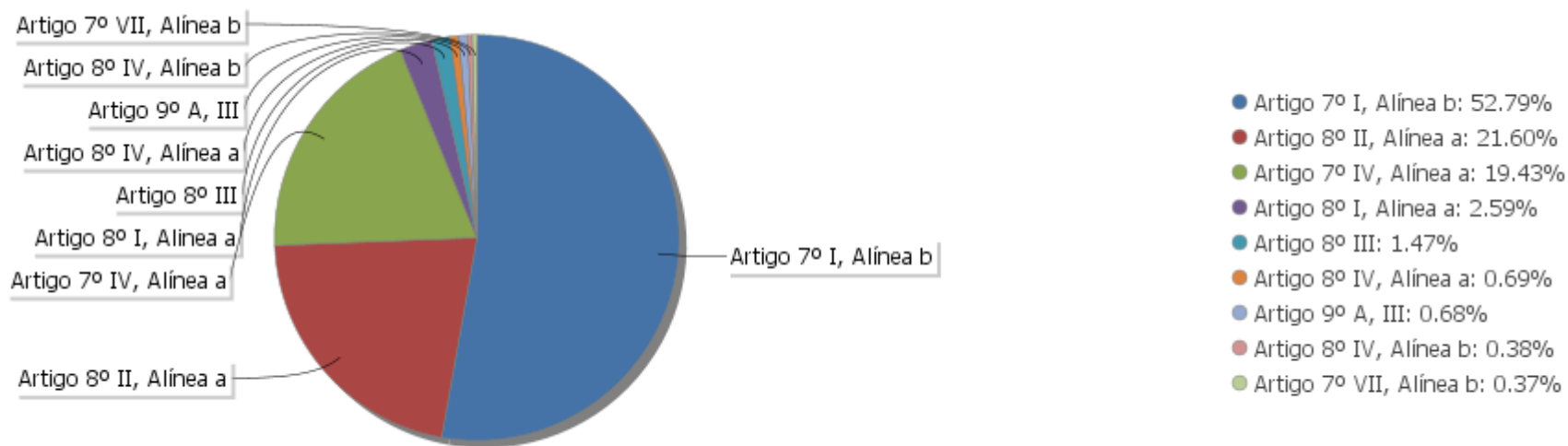
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,49 168,23	0,96 142,32	2,38 227,17	5,56 232,63	14,20 254,82	1.411.389,54	2.731.968,29
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,51 174,40	0,90 133,43	1,84 175,79	4,79 200,31	13,23 237,33	474.032,77	951.140,78
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,08 -25,96	-0,85 -126,40	-0,94 -89,66	33,65 1.406,86	32,41 581,45	-1.530,38	-17.896,17
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,33 0,10	-9,86 0,06	-3,69 0,06	2,97 -0,04	9,95 0,96	-1.273.842,13	-1.459.652,38
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,67 -0,24	-8,67 1,26	-0,23 3,52	5,39 2,39	16,88 7,89	-11.107.529,53	-11.442.787,42
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-7,44 0,99	-7,10 2,82	-4,66 -0,90	3,24 0,24	10,24 1,26	-638.840,02	-607.069,00
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,25 8,18	3,20 13,12	7,70 11,45	-0,50 -3,51	-2,56 -11,55	-9.118,82	115.090,99
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-3,29 5,14	-18,58 -8,65	-8,25 -4,50	7,60 4,60	10,66 1,68	-69.058,96	-463.450,55
Artigo 9º A, III % do CDI	-5,69 -1.935,50	0,46 68,96	-1,30 -124,40	8,85 369,86	26,84 481,52	-220.661,87	16.873,08
						-11.435.159,40	-10.175.782,38

Análise de Liquidez

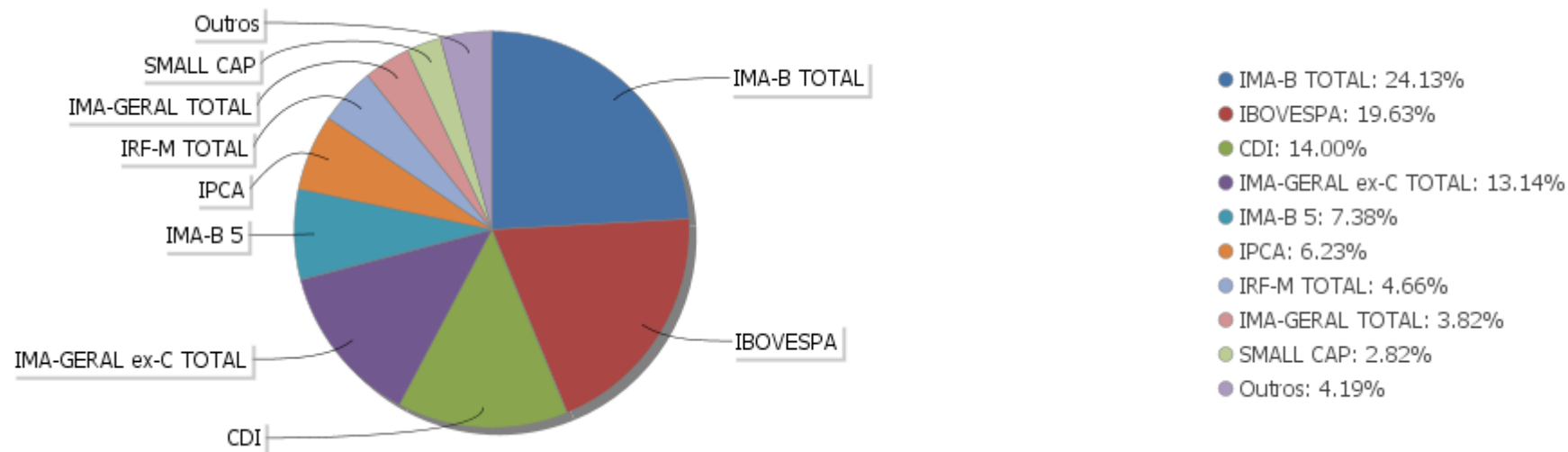
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	495.825.717,53	91,69	495.825.717,53	91,69
de 31 a 364 dias	28.338.506,11	5,24	524.164.223,64	96,93
acima de 365 dias	16.609.794,19	3,07	540.774.017,83	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

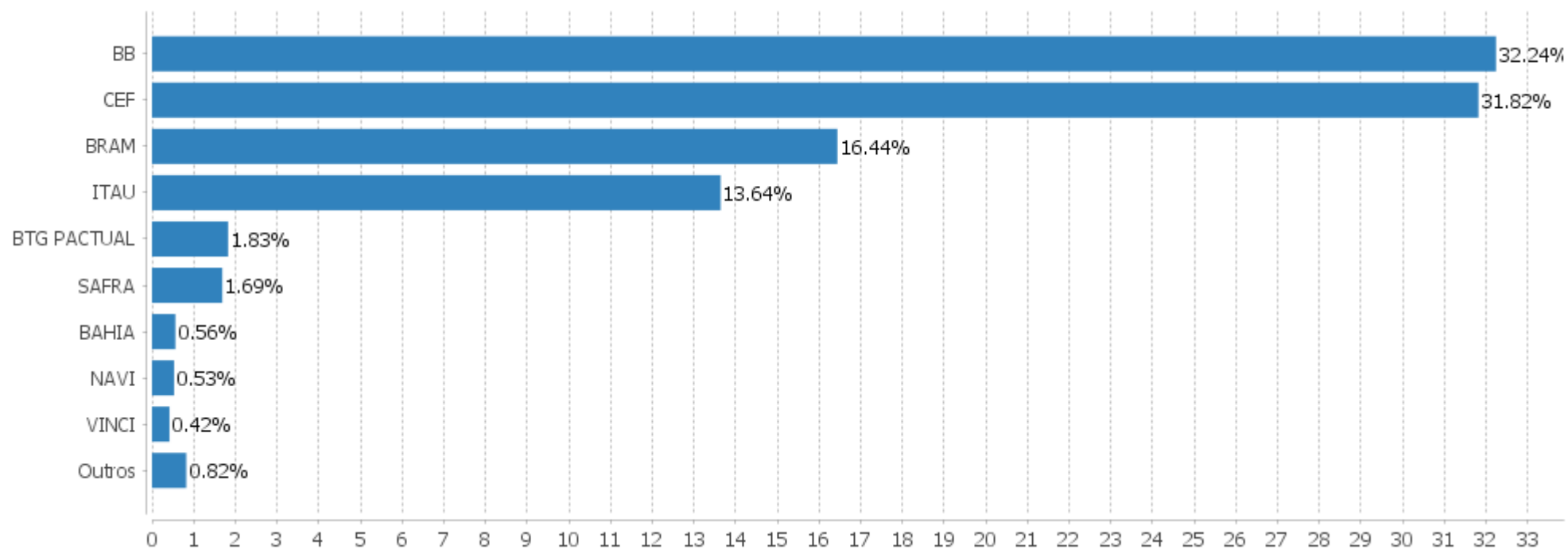


Alocação Por Estratégia



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	0,22	-2,06											-1,84
IPCA + 5,87%	0,71	0,66											1,37
p.p. indexador	-0,49	-2,71											-3,21
2019	2,76	0,29	0,45	1,18	2,10	3,07	1,36	0,18	2,07	2,37	-0,59	3,02	19,76
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	1,92	-0,61	-0,75	0,12	1,45	2,62	0,64	-0,44	1,63	1,74	-1,57	1,38	9,17
2018	4,20	0,36	1,03	-1,67	-2,24	-0,22	1,97	-0,52	0,71	3,59	1,00	1,28	9,70
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	3,40	-0,38	0,45	-2,38	-3,13	-1,97	1,13	-0,96	-0,21	2,63	0,75	0,67	-0,22

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

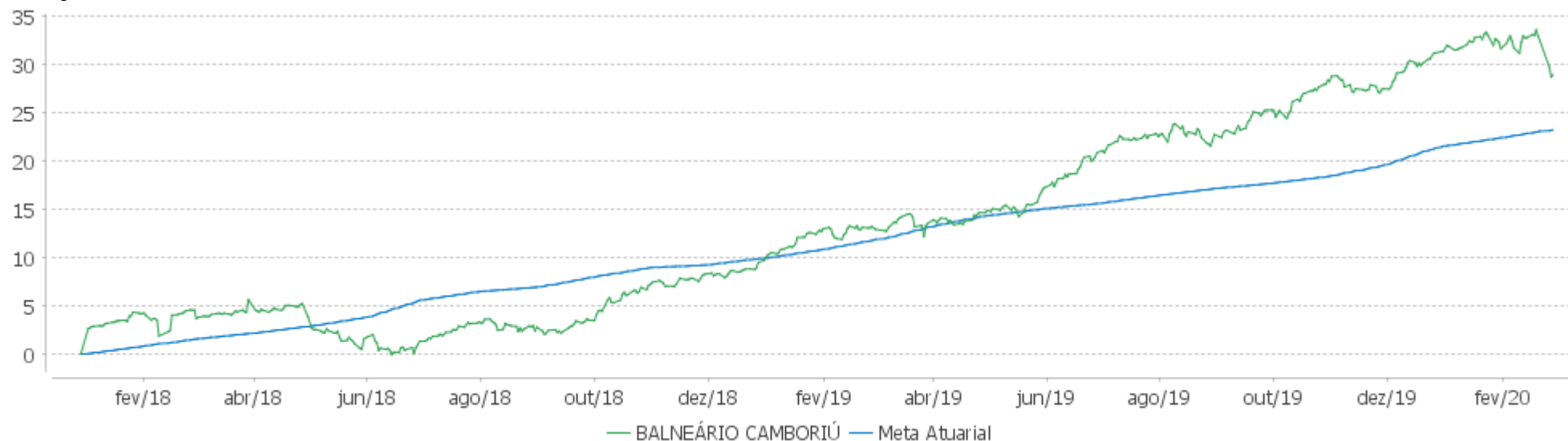
RELATÓRIO TRIMESTRAL

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	53,85	03 meses	1,13	3,04	-1,91	6,78
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	46,15	06 meses	5,05	5,17	-0,13	5,66
			12 meses	14,08	10,20	3,88	5,32
			24 meses	23,32	21,35	1,97	5,05
			36 meses				
Desde 29/12/2017				28,96	23,23	5,73	5,42

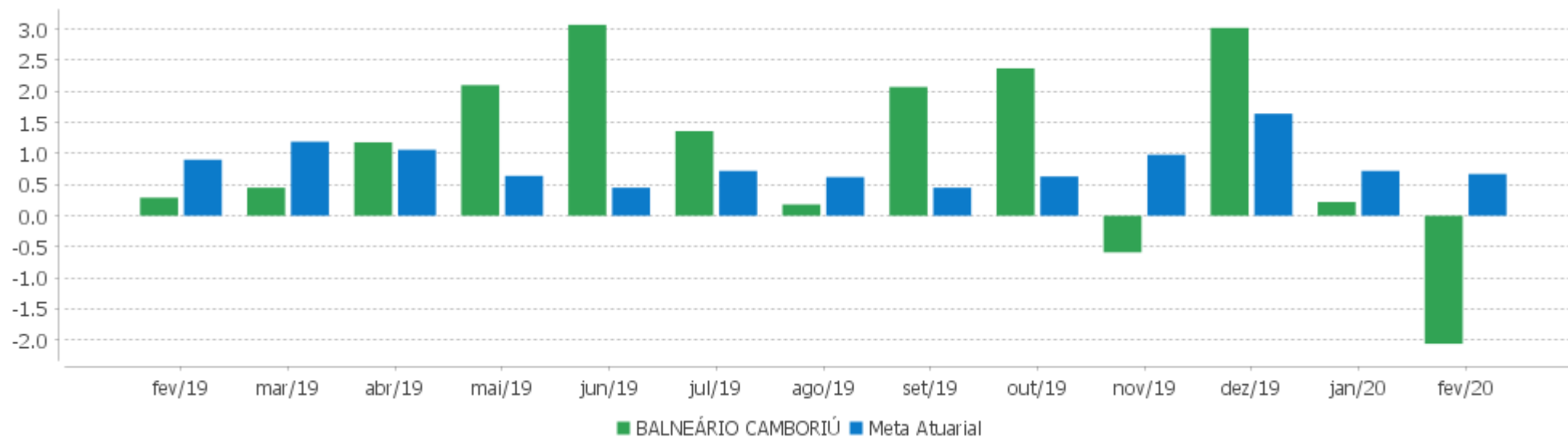
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2018-01
Menor rentabilidade da Carteira	-2,24	2018-05

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
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,72 0,27	1,41 0,70	2,71 -0,02	6,06 -0,49	13,94 -4,06	26,48 -8,17	41,88 -7,39
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO 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 IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO 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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,17 -0,03	2,40 -0,05	5,56 -0,10	11,93 -0,24	22,72 -0,77	36,55 -1,41
BB PREVID 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
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,04	0,66 -0,05	2,64 -0,10	6,39 -0,15	17,53 -0,48	33,67 -0,98	47,70 -1,57
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,93 -0,08	1,84 -0,07	4,27 -0,16	10,80 -0,48	21,36 -1,00	34,51 -1,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB 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 PREVIDENCIÁRIO 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
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,20	0,21 -0,50	1,00 -1,73	3,34 -3,20	7,18 -10,82	16,82 -17,83	27,29 -21,98
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,53 -0,14	1,85 0,45	3,22 0,16	5,10 -0,09	10,42 0,20	21,64 0,26	28,91 -3,32
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 0,20	1,00 0,29	3,27 0,53	7,33 0,78	18,54 0,54		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,01	0,68 -0,04	2,68 -0,05	6,42 -0,12	17,71 -0,29	33,57 -1,08	47,41 -1,85
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,04	0,61 -0,10	1,53 -1,20	4,15 -2,39	9,09 -8,91	20,06 -14,60	33,19 -16,08
BB PREV ALOC FIC 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
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA 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
BB PREV IMAB TPB	0,44	0,70	2,69	6,44	17,76	33,99	48,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,05	-0,10	-0,24	-0,66	-1,11
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,53	1,86	3,24	5,13	10,50	21,81	29,12
Var. INPC + 6% p.p.	-0,06	0,57	0,21	0,02	0,37	0,47	-1,74
BB PR IMA GERAL	0,43	0,91	1,81	4,26	10,82	21,34	34,47
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,02	-0,04	-0,06	-0,10	-0,25	-0,55	-0,97
BRABESCO H FI RF NILO	0,55	0,92	2,99	7,00	19,24	36,44	53,73
% do CDI	186,45	137,56	285,18	292,49	345,25	295,32	239,93
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,70	0,91	2,97	6,97	19,63	36,12	50,13
% do CDI	238,11	134,91	283,19	291,25	352,16	292,67	223,87
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,27	0,63	0,99	2,29	5,38	11,93	21,91
% do CDI	92,27	93,95	94,81	95,93	96,59	96,71	97,83
BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	1,07	2,03	2,57	5,40	12,14	24,04	41,40
% do CDI	362,93	301,81	245,45	225,77	217,86	194,84	184,88
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,27	0,62	0,98	2,23	5,33	11,98	22,11
% do CDI	92,98	92,92	93,45	93,12	95,61	97,04	98,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27	0,65	1,00	2,22	5,33	11,90	21,87
% do CDI	93,24	96,16	95,34	92,84	95,61	96,39	97,66
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	0,77	1,43	2,89	6,31	14,46	37,44	
Var. IPCA + 6% p.p.	0,10	0,04	-0,16	1,12	4,24	16,07	
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	0,59	0,75	1,21	3,86	10,56		
% do CDI	199,82	111,12	115,43	161,44	189,41		
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,47	1,04	1,98	4,49	11,36	22,33	35,97
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,02	0,03	0,06	0,06	0,07	-0,02	0,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,26	0,60	0,95	2,60	9,60	19,17	31,31
Var. IPCA p.p.	0,01	0,14	-0,67	0,40	5,60	11,12	20,19
PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	-0,08	-0,85	-0,94	33,65	32,41	29,86	-30,18
% do CDI	-25,96	-126,40	-89,66	1.406,86	581,45	242,00	-134,77
GÁVEA INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE	-0,72	-1,31	18,18	14,80	14,52	148,04	178,13
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,39	-2,70	15,12	9,60	4,30	126,66	145,90
FIP CAIXA CYRELA	-0,09	4,76	4,66	-7,14	-9,98	-3,66	
Var. IBOVESPA p.p.	8,34	14,68	8,42	-10,14	-18,96	-25,71	
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	1,05	-32,99	-44,98	-40,31	-44,29	-48,79	
Var. IFIX p.p.	4,74	-25,68	-47,52	-51,87	-66,03	-77,01	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE	-2,65	-12,23	-7,30	10,00	14,58	-86,25	
Var. IFIX p.p.	1,03	-4,92	-9,85	-1,56	-7,16	-114,48	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	-5,01	-26,30	-1,48	15,03	18,52	11,80	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IFIX p.p.	-1,32	-18,99	-4,03	3,47	-3,22	-16,43	
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-8,30 0,13	-9,83 0,09	-3,66 0,09	3,01 0,00	8,77 -0,21	21,22 -0,83	54,13 -2,14
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	-8,42 0,00	-9,95 -0,03	-3,73 0,02	2,91 -0,09	8,73 -0,26	21,78 -0,27	55,34 -0,93
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI Var. SMALL CAP p.p.	-8,85 -0,58	-8,51 -0,65	2,89 -0,91	11,46 -2,50	30,35 -5,35	44,12 -7,51	80,18 -19,65
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,28 2,15	-8,43 1,49	-0,15 3,60	5,34 2,34	17,00 8,02	49,89 27,85	92,47 36,20
BRADESCO FIA SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-11,06 -2,63	-12,20 -2,28	-5,89 -2,14	-3,70 -6,71	6,90 -2,09	22,97 0,92	65,96 9,69
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,29 1,14	-7,83 2,09	-0,14 3,62	6,88 3,88	13,79 4,81	30,65 8,60	68,06 11,80
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-9,27 -0,84	-7,93 1,99	1,46 5,21	4,94 1,94	20,69 11,71	47,79 25,75	88,59 32,32
FIA CONSTRUCAO CIVIL % do CDI	-10,66 -3.628,06	-7,40 -1.102,50	8,32 793,44	16,43 686,80	48,91 877,39	63,42 513,95	78,41 350,14
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-9,79	-9,96	-2,64	5,05	20,11	42,38	
FIC ACOES 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	75,29 7,68
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO Var. IBRX 100 p.p.	-8,16 0,06	-8,28 1,09	-1,45 1,33	4,65 1,10	14,83 3,68	31,67 6,20	71,41 10,72
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-8,40 -2,23	-10,89 -3,23	-4,45 -6,01	-0,38 -7,90	2,44 -19,20	17,94 -24,37	48,40 -19,21
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,13 1,30	-5,24 4,68	1,57 5,32	5,51 2,51	24,91 15,92	47,72 25,67	92,53 36,26
FIA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-10,05 -0,05	-7,01 -0,30	0,64 -0,14	4,73 0,29	34,98 0,22	29,06 -4,95	60,89 -6,38
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-8,60 -0,17	-8,14 1,78	3,39 7,14	12,78 9,78	32,42 23,44	43,20 21,15	89,76 33,49
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-7,78 0,65	-7,15 2,77	0,53 4,28	6,88 3,88	15,97 6,98	31,15 9,10	66,14 9,87
BB Ações Dividendos Var. IBOVESPA p.p.	-8,73 -0,30	-9,11 0,81	-1,64 2,12	1,17 -1,84	10,05 1,07	23,89 1,84	46,59 -9,68
MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	-8,75	-9,36	-1,36	5,90	19,71	51,51	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	-7,91 0,52	-6,42 3,50	3,34 7,09	10,51 7,51	27,29 18,31	57,75 35,71	106,37 50,11
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME Var. IBOVESPA p.p.	-7,44 0,99	-7,10 2,82	-4,66 -0,90	3,24 0,24	10,24 1,26	17,08 -4,97	45,10 -11,17
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-5,69 2,74	0,46 10,38	-1,30 2,45	8,85 5,84	26,84 17,86	48,66 26,61	81,60 25,33
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
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	3,54	6,84	14,98	14,49
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54
IPCA + 5,5%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 4%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

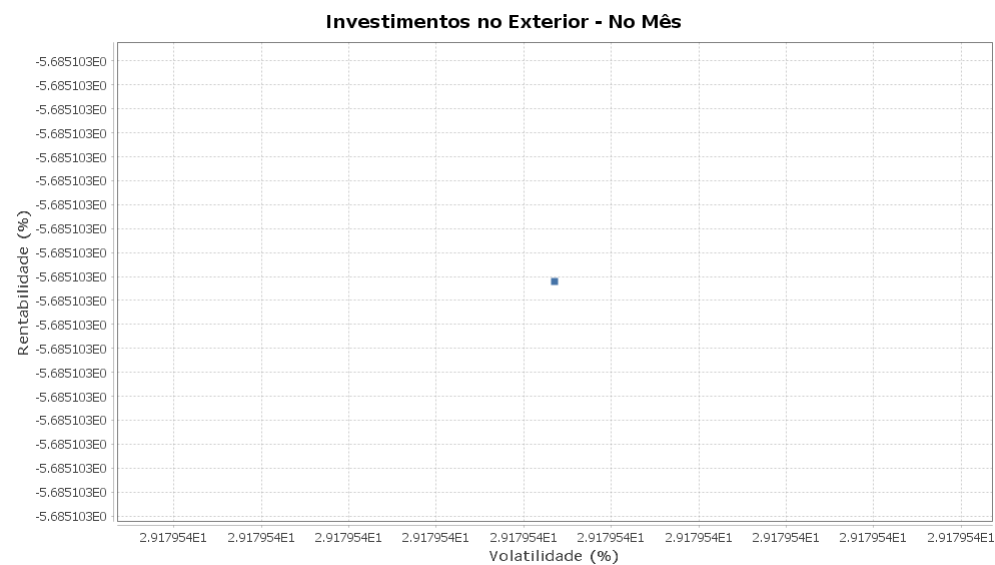
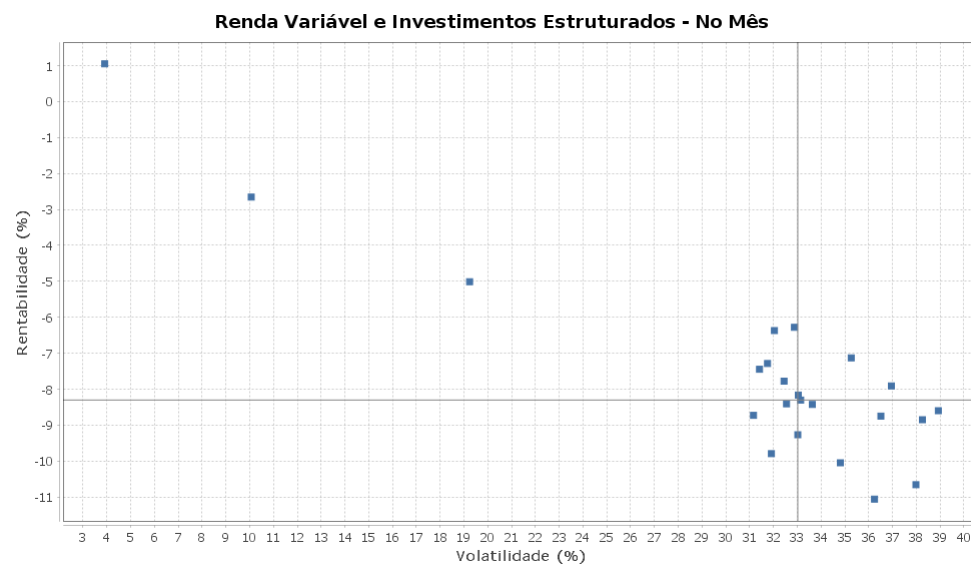
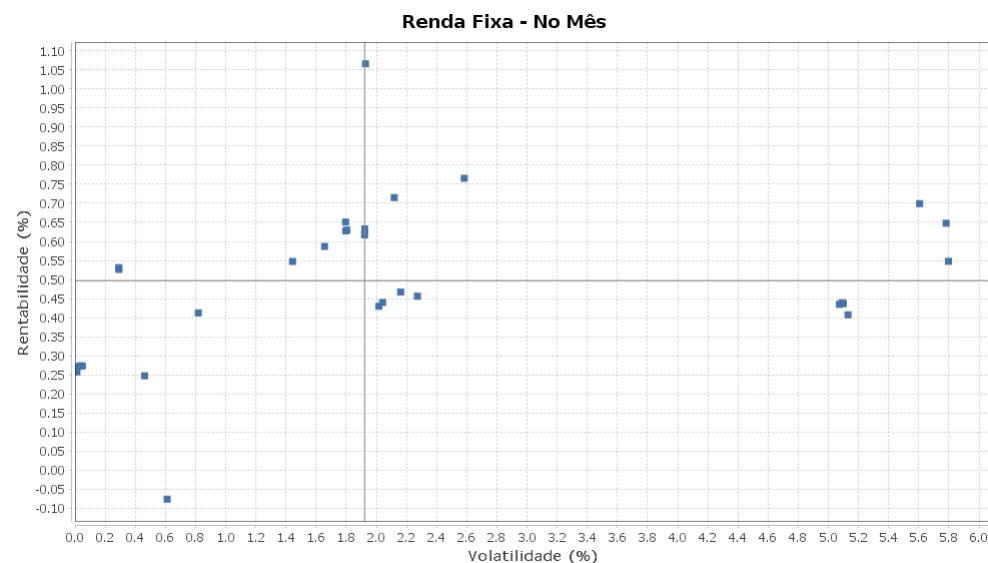
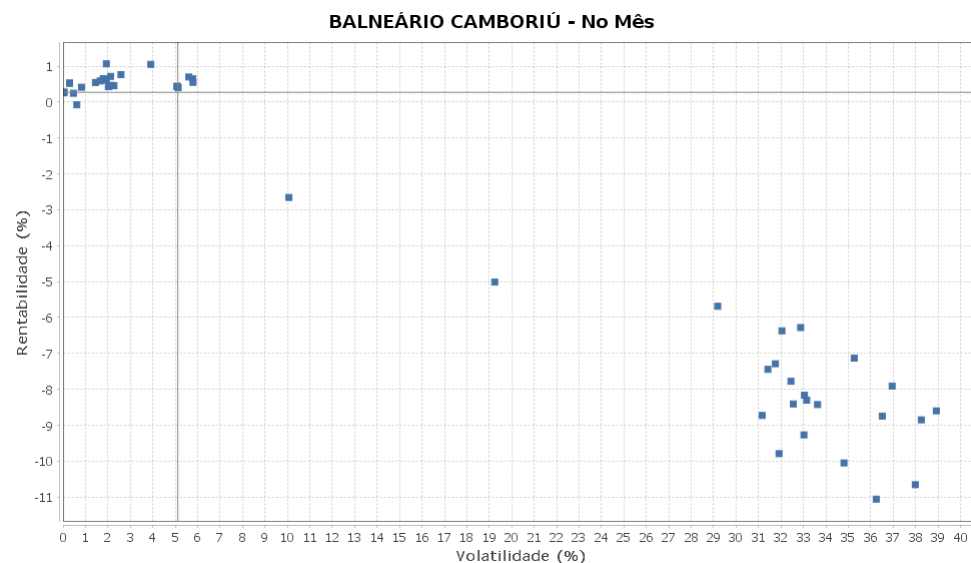
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
03/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	576.813,47	157.367,85760178	3,6653830000
03/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	488.000,00	139.461,08578457	3,4991840000
03/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	2.807,09	802,21274446	3,4991840000
03/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	10.000,00	2.857,80913493	3,4991840000
03/02/2020	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	1.500.000,00	0,00	476.031,69317460	3,1510507000
04/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	173.831,74	49.615,02290066	3,5036110000
04/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	3.524,52	1.005,96784289	3,5036110000
06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	16.000,00	4.555,92281356	3,5119120000
07/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.407,05	623,21823900	2,2577163390
07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	1.000,00	447,59511620	2,2341620000
10/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.644,54	0,00	21.100,20057100	2,2580136070
10/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	9.969,52	2.832,44875422	3,5197530000
11/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	135.000,00	0,00	36.798,01650514	3,6686760000
13/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	62.655,47	0,00	17.072,71195904	3,6699190000
13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	31.868,44	9.008,78958288	3,5374830000
17/02/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	34.507,31	15.828,28446000	2,1801042360
17/02/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	78.830,33	35.609,31059200	2,2137561410
17/02/2020	BB PREV RF VII	0,00	20.994,26	11.993,69867800	1,7504408410
17/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	29.159,59	7.943,06355957	3,6710760000
17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	67.571,58	19.033,35251553	3,5501670000
18/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.000.164,37	0,00	885.036,40807600	2,2599797610
19/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.031.339,14	0,00	280.850,94088166	3,6721940000
19/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.417.463,54	0,00	385.999,08937273	3,6721940000
19/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	275.016,80	0,00	74.891,68600570	3,6721940000
19/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.908.794,36	0,00	519.796,71008667	3,6721940000
20/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	44.681,65	0,00	19.765,43900500	2,2605948690
20/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.025.225,71	0,00	279.148,21903165	3,6726930000
21/02/2020	BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	0,00	2.000.000,00	78.813,13223501	25,3764816000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
26/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.332.788,90	907.182,74017027	3,6737790000
27/02/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.000.000,00	0,00	167.645,85677808	11,9299101000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.991,38	2.991,01610483	3,6747980000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	25.877,09	7.379,04617099	3,5068340000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,26	24.640.134,31	4,56
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,27	15.695.875,64	2,90
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,27	2.485.782,40	0,46
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,27	4.176.979,19	0,77
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,06	0,53	5.622.948,00	1,04
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,06	0,53	2.800.850,00	0,52
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,06	0,25	3.198.860,49	0,59
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,61	0,06	-0,08	2.005.197,84	0,37
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,82	0,11	0,41	781.268,28	0,14
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	0,18	0,55	1.327.491,76	0,25
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	1,66	0,20	0,59	10.587.422,14	1,96
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,65	23.459.023,96	4,34
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	2.960.413,22	0,55
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	11.679.183,76	2,16
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,62	7.559.744,77	1,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,63	24.079.986,31	4,45
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	1,93	0,26	1,07	2.888.276,06	0,53
BB PR IMA GERAL	Artigo 7º I, Alínea b	2,02	0,23	0,43	4.405.168,12	0,81
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	0,24	0,44	13.450.474,28	2,49
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,12	0,26	0,72	3.160.682,08	0,58
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,16	0,25	0,47	6.303.993,92	1,17
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,26	0,46	63.494.071,90	11,74
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	2,58	0,31	0,77	6.401.395,19	1,18
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	3,91	0,46	1,05	91.120,54	0,02
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,07	0,55	0,43	3.322.172,52	0,61
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,44	66.523.085,60	12,30
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	5,10	0,55	0,44	44.150.097,23	8,16
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,13	0,55	0,41	2.418.422,61	0,45
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,61	0,62	0,70	12.547.128,85	2,32
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,78	0,63	0,65	1.147.920,88	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,80	0,63	0,55	19.337.977,05	3,58
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	10,07	0,89	-2,65	1.254.000,00	0,23
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	19,24	1,71	-5,01	685.953,00	0,13
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	29,18	2,70	-5,69	3.660.743,08	0,68
BB Ações Dividendos	Artigo 8º II, Alínea a	31,16	2,72	-8,73	7.781.296,44	1,44
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	Artigo 8º III	31,42	2,83	-7,44	7.943.724,01	1,47
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	31,75	2,87	-7,29	3.049.746,59	0,56
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	31,91	2,73	-9,79	9.554.869,56	1,77
FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	2,95	-6,37	2.258.110,52	0,42
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	32,44	2,91	-7,78	3.391.064,56	0,63
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	32,55	2,88	-8,40	8.797.673,83	1,63
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,88	3,05	-6,28	2.867.747,19	0,53
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	33,02	2,88	-9,27	6.507.681,81	1,20
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	33,04	2,95	-8,16	1.794.448,54	0,33
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	33,14	2,95	-8,30	10.407.092,88	1,92
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	33,63	3,00	-8,42	3.606.937,88	0,67
FIA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	34,81	3,02	-10,05	2.647.507,45	0,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	35,27	3,24	-7,13	7.409.171,76	1,37
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	36,25	3,10	-11,06	9.489.667,17	1,75
MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	36,51	3,27	-8,75	1.496.086,34	0,28
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	36,95	3,37	-7,91	20.674.978,31	3,82
FIA CONSTRUCAO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	37,99	3,31	-10,66	2.633.954,85	0,49
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	38,25	3,45	-8,85	14.562.133,35	2,69
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	38,92	3,53	-8,60	11.884.073,58	2,20