



**BALNEÁRIO CAMBORIÚ**  
MARÇO 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

**RENTA FIXA** **75,92%**

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 TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF	10,74	-6,65	-6,04	2.257.569,85	0,47	181.128.548,29	1,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	4,55	-1,71	-0,56	2.909.772,62	0,60	1.560.138.713,72	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11,04	-6,95	-6,32	3.091.377,64	0,64	346.254.084,73	0,89
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-6,33	41.067.103,43	8,48	5.743.378.118,49	0,72
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	61.617.437,22	12,72	5.890.819.394,91	1,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	4,75	-1,97	-1,06	13.185.228,80	2,72	1.326.400.859,08	0,99
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	27.050.747,76	5,58	9.363.308.744,85	0,29
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	16,80	-11,12	-11,12	3.466.273,73	0,72	1.940.264.057,52	0,18
BB	BB	BB PR IMA GERAL	4,64	-2,01	-1,12	4.316.691,55	0,89	569.966.882,78	0,76
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	5,02	-0,11	1,36	44.598,41	0,01	15.907.113.181,36	0,00
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,56	-1,79	-0,60	23.038.818,37	4,76	4.397.326.460,64	0,52
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	5,68	-2,06	-0,68	3.095.583,58	0,64	277.202.048,31	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,22	-1,34	-0,74	770.789,27	0,16	667.671.168,60	0,12
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	5,33	-2,10	-1,18	58.743.386,37	12,13	10.536.452.770,12	0,56
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	5,32	-0,13	1,31	7.549.866,06	1,56	11.020.077.699,37	0,07
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	12,58	-6,70	-5,76	1.071.046,67	0,22	1.514.006.564,36	0,07
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,13	-1,13	-0,92	3.162.629,19	0,65	983.585.151,09	0,32
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	3,85	-1,71	-0,75	1.304.856,03	0,27	865.069.606,77	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,77	2,63	5.666.260,00	1,17	190.560.022,78	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,36	0,78	2,65	2.822.594,00	0,58	215.901.909,33	1,31
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,42</b>	<b>-4,09</b>	<b>-3,17</b>	<b>266.232.630,55</b>	<b>54,95</b>		

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	0,06	0,32	0,95	11.737.907,40	2,42	7.002.951.216,89	0,17
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	12,89	-6,12	-5,27	11.779.731,67	2,43	389.255.098,96	3,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,14	0,31	2.854.973,30	0,59	5.503.080.783,31	0,05
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,09	-2,07	-1,06	6.173.224,94	1,27	845.014.261,73	0,73
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	-0,03	0,59	2.183.034,48	0,45	2.725.355.805,79	0,08
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	17,06	2,68	2,68	2.053.644,58	0,42	277.385.545,74	0,74
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	13,56	-7,55	-6,70	17.877.098,68	3,69	764.497.607,44	2,34
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,32	0,53	1,13	24.770.409,94	5,11	5.019.962.419,71	0,49
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,01	1,21	3,26	2.923.182,73	0,60	886.391.609,05	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,36	3,47	4,24	10.955.055,04	2,26	821.904.874,24	1,33
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	5,54	-1,89	-0,49	6.280.098,66	1,30	81.609.148,66	7,70
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,11	-2,04	-1,16	99.588.361,42	20,56		

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	32,38	-0,20	-1,05	1.991.116,55	0,41	113.413.604,77	1,76
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			32,38	-0,20	-1,05	1.991.116,55	0,41		
Renda Fixa			6,76	-3,54	-2,64	367.812.108,52	75,92		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,91%

## 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	BRABESCO	BRABESCO FIA IBOVESPA PLUS	40,74	-29,93	-36,82	3.896.557,18	0,80	295.198.290,54	1,32
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	40,32	-29,71	-36,62	8.702.561,79	1,80	477.022.607,99	1,82
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>40,42</b>	<b>-29,78</b>	<b>-36,71</b>	<b>12.599.118,97</b>	<b>2,60</b>		

## 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	BRABESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	40,05	-30,29	-36,72	1.250.943,33	0,26	11.767.339,84	10,63
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	40,65	-31,54	-39,89	6.496.829,74	1,34	557.582.118,41	1,17
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	42,56	-37,39	-42,72	9.116.742,37	1,88	326.476.617,31	2,79
BB	BB	BB Ações Dividendos	34,90	-29,38	-35,81	5.495.393,75	1,13	751.642.834,81	0,73
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	38,17	-27,45	-35,35	6.382.773,06	1,32	1.656.219.425,52	0,39
BRAM	BEM	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	40,05	-31,64	-36,03	14.132.859,65	2,92	1.534.763.661,47	0,92
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	40,38	-31,34	-36,25	2.328.250,06	0,48	577.164.782,79	0,40
CEF	CEF	FIA CONSTRUCAO CIVIL	51,66	-41,14	-49,23	1.550.429,61	0,32	416.036.779,10	0,37
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	41,94	-31,71	-35,29	5.059.497,30	1,04	1.382.617.129,81	0,37
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	41,23	-30,69	-36,11	2.113.930,88	0,44	777.057.191,68	0,27
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	39,67	-27,86	-33,94	2.068.772,64	0,43	792.607.115,72	0,26
CEF	CEF	FIA CONSUMO	42,01	-31,23	-40,48	1.820.780,90	0,38	544.828.665,14	0,33
VINCI	CEF	FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	35,44	-27,40	-30,98	1.639.369,27	0,34	668.247.605,13	0,25
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	43,23	-35,06	-40,34	7.717.752,52	1,59	894.019.781,17	0,86
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	45,77	-36,49	-42,43	2.251.179,01	0,46	1.335.839.057,21	0,17
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	38,94	-32,44	-39,18	6.454.826,33	1,33	2.717.755.336,40	0,24
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	46,64	-41,88	-46,49	3.782.040,59	0,78	1.314.153.409,58	0,29
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>40,22</b>	<b>-32,97</b>	<b>-38,78</b>	<b>79.662.371,01</b>	<b>16,44</b>		

## 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	28,59	-14,56	-20,62	8.485.337,03	1,75	330.179.248,95	2,57
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>28,59</b>	<b>-14,56</b>	<b>-20,62</b>	<b>8.485.337,03</b>	<b>1,75</b>		

### 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	65,73	-1,45	-2,74	900.765,17	0,19	20.384.112,51	4,42
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	24,75	5,43	10,45	2.817.616,50	0,58	139.180.433,62	2,02
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>25,15</b>	<b>3,67</b>	<b>6,99</b>	<b>3.718.381,67</b>	<b>0,77</b>		

### 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	26,15	-13,94	-24,47	1.079.200,00	0,22	150.315.000,00	0,72
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	49,99	-24,62	-44,45	517.050,00	0,11	592.356.534,00	0,09
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,87	-0,30	-33,44	90.519,17	0,02	15.667.387,54	0,58
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>38,01</b>	<b>-16,94</b>	<b>-32,37</b>	<b>1.686.769,17</b>	<b>0,35</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>36,99</b>	<b>-30,28</b>	<b>-36,24</b>	<b>106.151.977,85</b>	<b>21,91</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,17%

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	22,92	1,01	1,01	1.515.095,35	0,31	9.050.054,13	16,74
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	24,75	2,22	2,22	3.066.738,35	0,63	124.469.195,64	2,46
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>39,78</b>	<b>1,82</b>	<b>1,82</b>	<b>4.581.833,70</b>	<b>0,95</b>		

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	23,76	6,30	6,80	5.934.852,57	1,22	876.229.505,18	0,68
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>23,76</b>	<b>6,30</b>	<b>6,80</b>	<b>5.934.852,57</b>	<b>1,22</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>21,41</b>	<b>6,15</b>	<b>6,64</b>	<b>10.516.686,27</b>	<b>2,17</b>		
<b>Total</b>						<b>484.480.772,64</b>	<b>100,00</b>		

## 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	266.232.630,55	54,95	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.588.361,42	20,56	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.991.116,55	0,41	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	367.812.108,52	75,92				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	12.599.118,97	2,60	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	79.662.371,01	16,44	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	8.485.337,03	1,75	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.718.381,67	0,77	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.686.769,17	0,35	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	106.151.977,85	21,91				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	4.581.833,70	0,95	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.934.852,57	1,22	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	10.516.686,27	2,17				



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

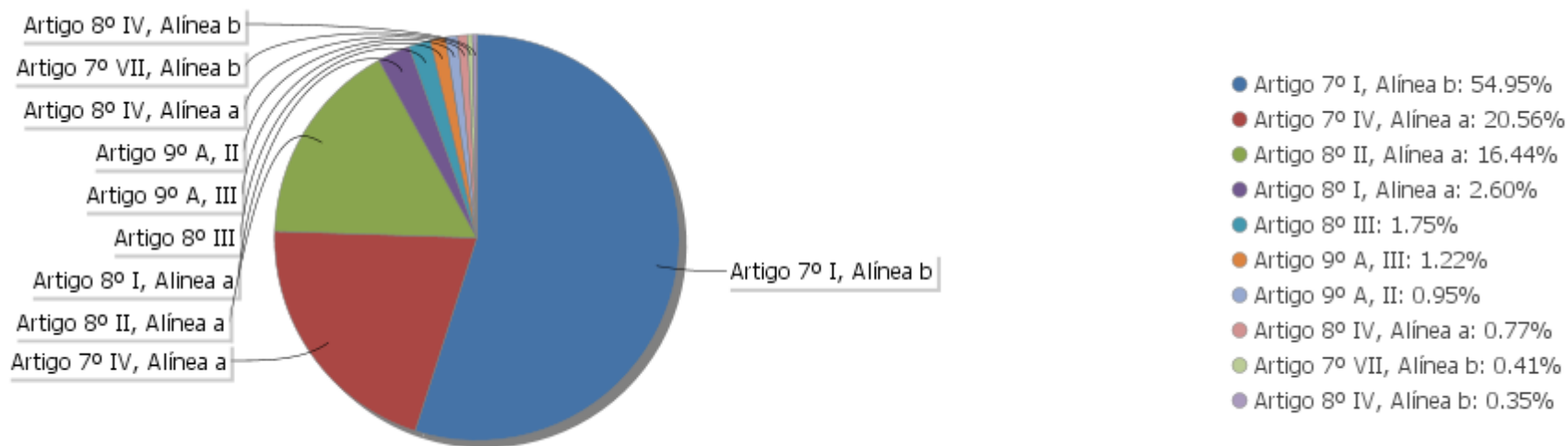
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-4,09 -1.208,06	-3,17 -313,33	-3,17 -313,33	-0,98 -43,17	8,92 164,14	-11.312.849,01	-8.580.880,72
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-2,04 -601,66	-1,16 -114,43	-1,16 -114,43	0,71 31,29	10,32 189,73	-1.854.145,01	-903.004,23
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,20 -59,66	-1,05 -103,64	-1,05 -103,64	31,42 1.387,64	32,28 593,76	-3.977,22	-21.873,39
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-29,78 0,12	-36,71 0,15	-36,71 0,15	-30,15 0,13	-22,64 0,83	-5.414.911,79	-6.874.564,17
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-32,97 -3,07	-38,78 -1,92	-38,78 -1,92	-30,74 -0,45	-21,15 2,32	-39.137.840,84	-50.580.628,26
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-14,56 15,35	-20,62 16,24	-20,62 16,24	-13,66 16,62	-7,63 15,84	-1.458.386,98	-2.065.455,98
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,67 33,58	6,99 43,85	6,99 43,85	11,73 42,02	2,73 26,20	131.925,94	247.016,93
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-16,94 12,97	-32,37 4,49	-32,37 4,49	-9,60 20,69	-9,02 14,45	-343.974,37	-807.424,92
Artigo 9º A, II % do CDI	1,82 594,30	1,82 594,30				81.833,70	81.833,70
Artigo 9º A, III % do CDI	6,30 1.863,01	6,80 671,49	6,80 671,49	12,71 561,33	27,06 497,76	274.109,49	290.982,57
						-59.038.216,09	-69.213.998,47

## Análise de Liquidez

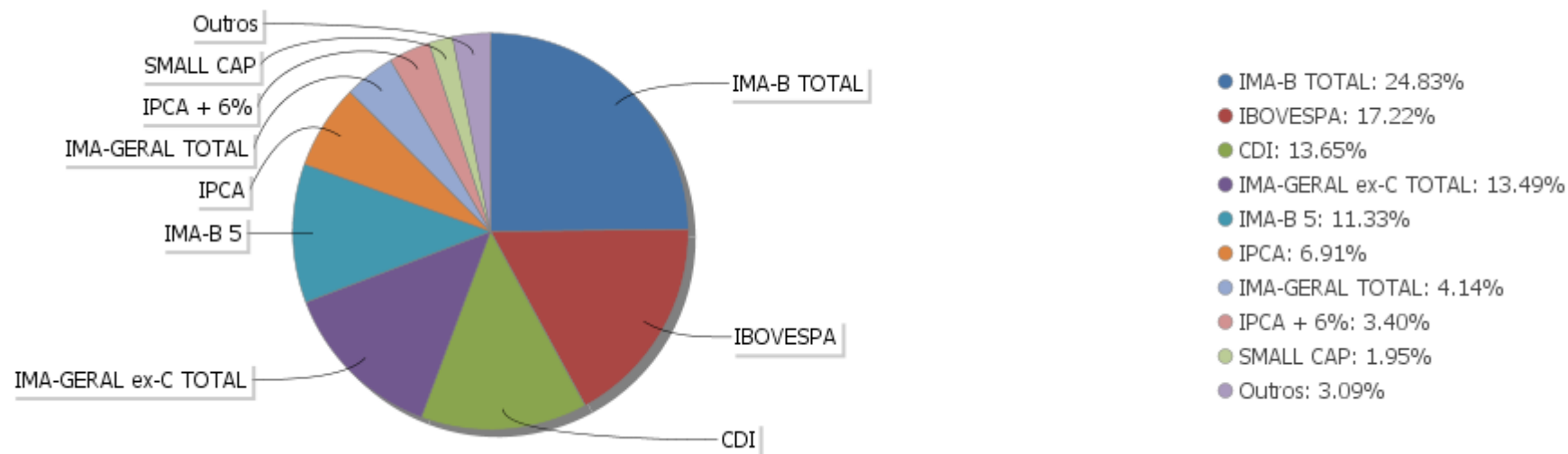
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	447.434.759,93	92,35	447.434.759,93	92,35
de 31 a 364 dias	20.499.025,61	4,23	467.933.785,54	96,58
acima de 365 dias	16.546.987,10	3,42	484.480.772,64	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

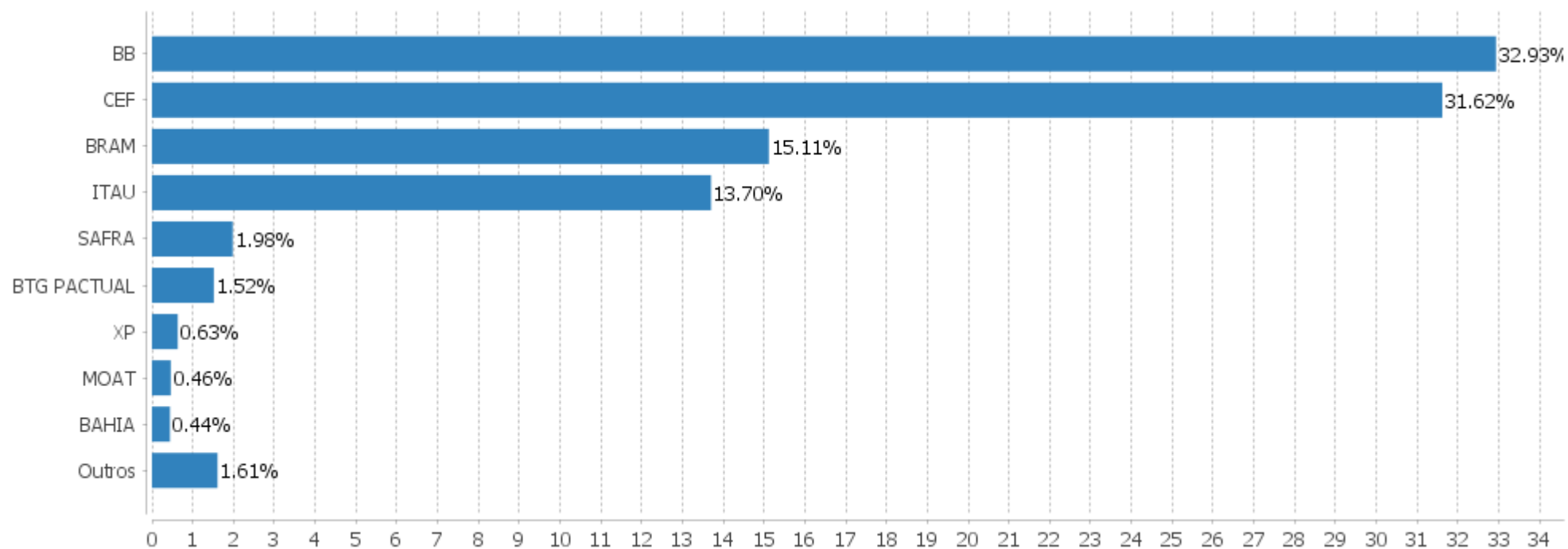


### Alocação Por Estratégia



## 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	-10,98										-12,62
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57										1,95
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55										-14,57
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

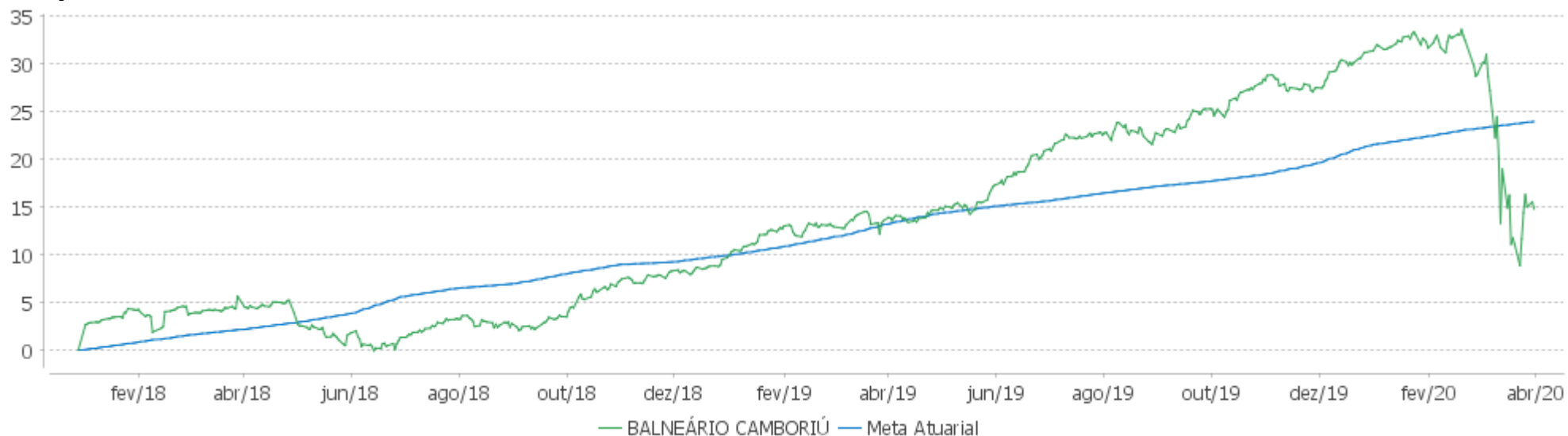
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

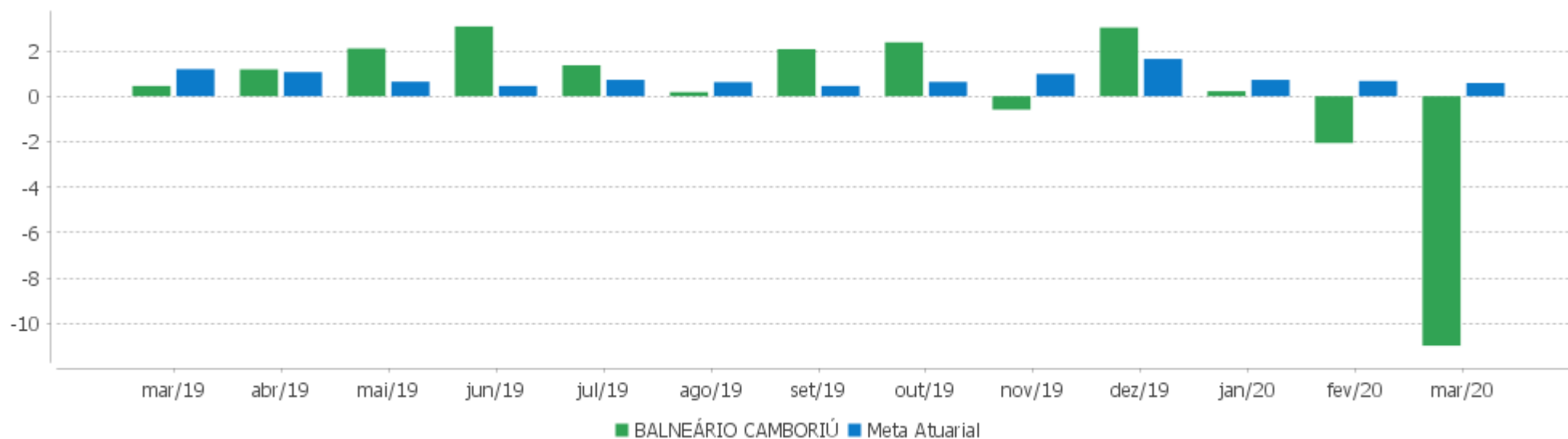
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	51,85	03 meses	-12,62	1,95	-14,57	25,53
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	48,15	06 meses	-8,39	5,30	-13,69	18,24
			12 meses	1,10	9,52	-8,42	13,25
			24 meses	8,66	21,35	-12,68	10,01
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2018-01	Desde 29/12/2017	14,80	23,93	-9,14	9,81
Menor rentabilidade da Carteira	-10,98	2020-03					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	-0,20 -59,66	-1,05 -103,64	-1,05 -103,64	31,42 1.387,64	32,28 593,76	29,81 245,86	-30,59 -142,08
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,06 4,91	-0,68 5,63	-0,68 5,63	1,89 5,53	10,67 1,53	21,36 -2,74	36,83 -0,60
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO 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 IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO 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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	-1,71 0,04	-0,56 0,01	-0,56 0,01	1,99 -0,03	9,18 -0,15	18,74 -0,65	32,42 -1,25
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,79 -0,04	-0,60 -0,03	-0,60 -0,03	1,92 -0,11	9,12 -0,21	18,91 -0,48	32,93 -0,74
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,65 0,32	-6,04 0,27	-6,04 0,27	-3,44 0,20	9,12 -0,02	23,66 -0,44	36,48 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB 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 GERAL TP RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-1,97 0,01	-1,06 -0,07	-1,06 -0,07	0,76 -0,13	8,07 -0,40	17,87 -0,92	30,31 -1,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	-1,71 -2,40	-0,75 -2,74	-0,75 -2,74	1,75 -3,64	8,65 -0,91	28,74 7,24	40,59 9,94
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,13 5,84	-0,92 5,39	-0,92 5,39	1,46 5,11	5,35 -3,79	13,64 -10,47	23,81 -13,61
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,77 0,19	2,63 0,65	2,63 0,65	5,32 -0,01	10,19 0,63	21,68 0,30	28,83 -3,13
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,95 0,03	-6,32 -0,01	-6,32 -0,01	-3,70 -0,06	8,94 -0,21	23,20 -0,91	35,81 -1,62
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,70 0,28	-5,76 0,55	-5,76 0,55	-2,75 0,89	10,06 0,92		
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,34 5,63	-0,74 5,57	-0,74 5,57	1,66 5,30	6,93 -2,21	16,97 -7,14	29,44 -7,98
BB PREV ALOC FIC 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 BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	-0,13	1,31	1,31	3,13	13,46	23,65	35,73

## 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.	-0,20	0,78	0,78	0,82	10,16	15,62	24,81
BB PREV IMAB TPB	-6,98	-6,33	-6,33	-3,73	8,93	23,52	36,42
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,02	-0,02	-0,09	-0,22	-0,58	-1,00
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,78	2,65	2,65	5,36	10,26	21,85	29,03
Var. INPC + 6% p.p.	0,09	0,66	0,66	-0,03	0,70	0,35	-1,61
BB PR IMA GERAL	-2,01	-1,12	-1,12	0,72	8,03	17,81	30,21
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07	-0,11	-0,11	-0,16	-0,31	-0,60	-1,01
BB PREV IMA-B5+	-10,89	-10,58	-10,58	-7,80	8,16	26,53	38,86
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,04	0,04	0,04	0,11	-0,07	-0,41	-1,08
BRADESCO H FI RF NILO	-7,55	-6,70	-6,70	-4,04	9,76	24,47	40,19
% do CDI	-2.232,60	-662,04	-662,04	-178,64	179,46	201,82	186,65
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-6,12	-5,27	-5,27	-2,62	11,82	26,66	39,54
% do CDI	-1.807,52	-520,27	-520,27	-115,93	217,40	219,90	183,66
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,32	0,95	0,95	2,16	5,24	11,72	21,04
% do CDI	94,78	94,22	94,22	95,49	96,42	96,63	97,72
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	-0,03	0,59	0,59	1,74	4,81	11,34	20,78
% do CDI	-9,77	58,36	58,36	76,63	88,50	93,51	96,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	1,21	3,26	3,26	5,07	12,88	23,56	41,09
% do CDI	357,17	322,06	322,06	223,79	236,92	194,30	190,84
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14	0,79	0,79	1,91	4,99	11,48	20,75
% do CDI	42,04	77,94	77,94	84,42	91,77	94,69	96,38
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	-1,89	-0,49	-0,49	2,15	11,18	33,86	
Var. IPCA + 6% p.p.	-2,48	-2,47	-2,47	-3,18	1,63	12,48	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	-11,33	-11,10	-11,10	-8,43	7,39	25,57	37,80
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,39	-0,48	-0,48	-0,52	-0,85	-1,37	-2,14
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	3,47	4,24	4,24	6,85	13,21		
% do CDI	1.026,20	419,36	419,36	302,74	243,01		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,53	1,13	1,13	2,34	9,75	18,58	30,29
Var. IPCA p.p.	0,46	0,60	0,60	0,03	6,45	10,56	19,37
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	-2,07	-1,06	-1,06	0,84	8,50	18,60	31,49
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,09	-0,07	-0,07	-0,05	0,03	-0,19	-0,11
GÁVEA INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE	-1,45	-2,74	-2,74	13,25	12,98	145,80	177,28
Var. IPCA + 6% p.p.	-2,03	-4,72	-4,72	7,92	3,43	124,42	145,31
FIP CAIXA CYRELA	5,43	10,45	10,45	10,40	-2,74	1,71	
Var. IBOVESPA p.p.	35,33	47,31	47,31	40,69	20,74	16,18	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	-14,56	-20,62	-20,62	-13,66	-7,63	2,85	22,88



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	15,35	16,24	16,24	16,62	15,84	17,31	10,52
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII Var. IFIX p.p.	-0,66 15,19	-33,44 -11,43	-33,44 -11,43	-41,16 -34,08	-44,85 -45,30	-49,47 -55,26	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE Var. IFIX p.p.	-13,94 1,91	-24,47 -2,47	-24,47 -2,47	-3,57 3,52	-1,33 -1,78	-88,64 -94,43	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA Var. IFIX p.p.	-24,62 -8,77	-44,45 -22,45	-44,45 -22,45	-13,03 -5,95	-13,49 -13,95	-15,78 -21,57	
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI Var. SMALL CAP p.p.	-37,39 -2,33	-42,72 -2,55	-42,72 -2,55	-31,50 -3,99	-17,87 -5,89	-9,73 -8,11	15,28 -16,39
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-27,86 2,04	-33,94 2,91	-33,94 2,91	-25,53 4,76	-14,99 8,49	5,24 19,70	42,37 30,01
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-31,54 -1,63	-39,89 -3,03	-39,89 -3,03	-34,30 -4,01	-26,99 -3,52	-17,46 -3,00	19,95 7,59
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-30,69 -0,78	-36,11 0,75	-36,11 0,75	-28,12 2,17	-21,54 1,93	-9,49 4,98	19,44 7,07
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-41,88 -11,98	-46,49 -9,64	-46,49 -9,64	-38,72 -8,43	-29,21 -5,74	-15,65 -1,19	11,25 -1,12
FIA CONSTRUCAO CIVIL % do CDI	-41,14 -12.157,35	-45,49 -4.495,05	-45,49 -4.495,05	-31,86 -1.407,05	-9,18 -168,83	-2,76 -22,80	4,20 19,49
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-32,44	-39,18	-39,18	-31,38	-17,47	-4,42	
FIC ACOES 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
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO Var. IBRX 100 p.p.	-30,29 -0,20	-36,06 0,58	-36,06 0,58	-29,01 0,85	-20,12 2,09	-9,07 3,28	22,35 7,30
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-31,71 -1,81	-35,29 1,57	-35,29 1,57	-28,84 1,45	-13,47 10,00	-1,01 13,45	30,58 18,21
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-27,45 -1,92	-35,35 -4,11	-35,35 -4,11	-29,67 -8,26	-25,32 -17,55	-15,86 -20,74	9,55 -17,62
FIA 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
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-31,34 -1,44	-36,25 0,61	-36,25 0,61	-28,08 2,20	-19,74 3,73	-9,77 4,69	16,24 3,87
MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	-36,49	-42,43	-42,43	-34,82	-22,81	-5,17	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB Ações Dividendos Var. IBOVESPA p.p.	-29,38 0,53	-35,81 1,05	-35,81 1,05	-29,79 0,50	-21,20 2,27	-13,42 1,04	5,74 -6,63
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	-31,64 -1,74	-36,03 0,83	-36,03 0,83	-26,34 3,95	-12,50 10,97	5,75 20,21	42,39 30,02
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-29,71 0,19	-36,62 0,24	-36,62 0,24	-30,06 0,23	-23,40 0,08	-14,79 -0,32	11,23 -1,13
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	-29,93 -0,03	-36,90 -0,05	-36,90 -0,05	-30,35 -0,06	-23,66 -0,19	-14,67 -0,21	11,58 -0,79
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	2,01 31,92	14,27 51,13	14,27 51,13	23,40 53,68	32,83 56,31		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	7,43 6,85	13,43 11,44	13,43 11,44				
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,30 36,21	6,80 43,65	6,80 43,65	12,71 43,00	27,06 50,53	62,46 76,92	91,78 79,42
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
<b>Meta Atuarial</b>							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

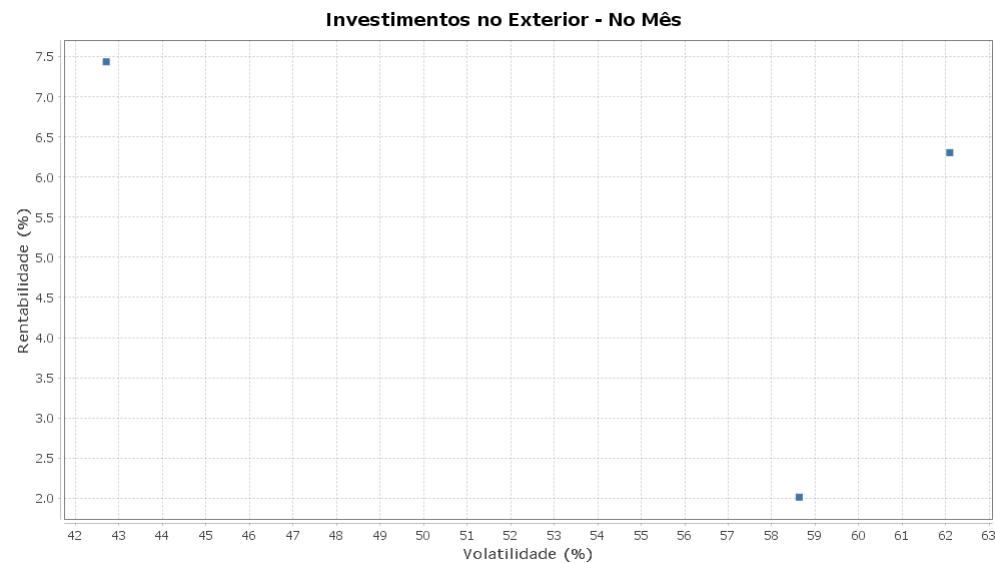
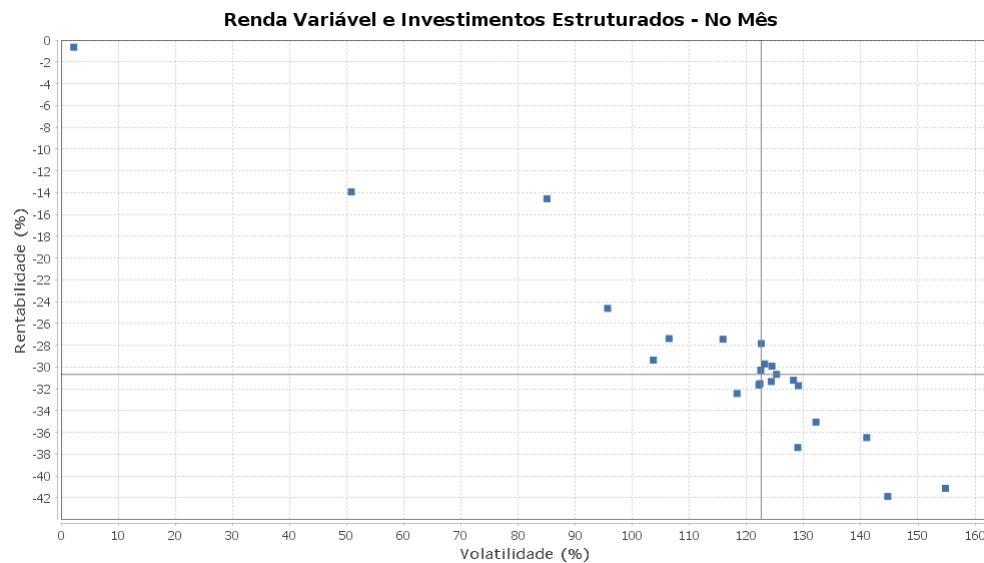
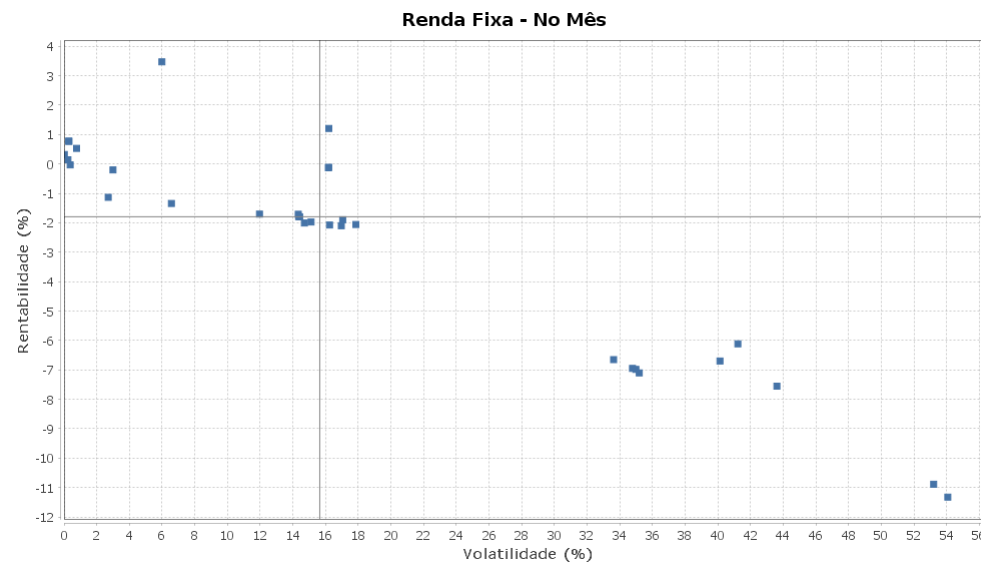
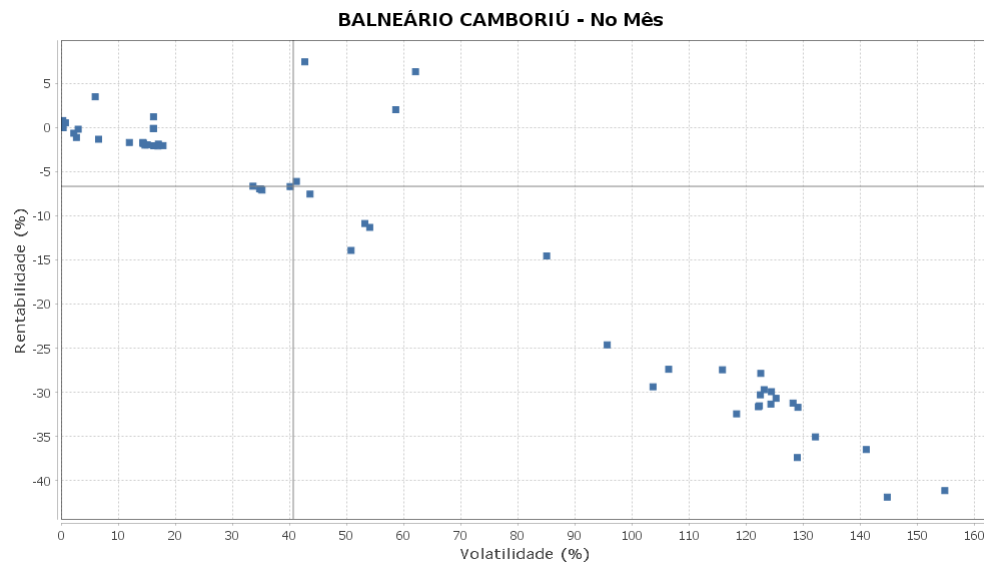
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	19.000.000,00	8.421.619,98281989	2,2560980000
02/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	186.572,36	52.793,20841806	3,5340220000
02/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.500.000,00	1.547.180,66455600	2,2621792530
02/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	12.000.000,00	0,00	3.939.585,14855191	3,0460060000
02/03/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	2.000.000,00	167.598,43716133	11,9332855000
02/03/2020	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	2.000.000,00	0,00	2.349,31653566	851,3114217000
02/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	775.037,47	210.869,24535042	3,6754410000
03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4.153.886,62	0,00	1.360.863,65765843	3,0523900000
03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	4.153.886,62	1.838.422,67526568	2,2594840000
03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	1.000,00	282,44398783	3,5405250000
03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	7.613,72	2.150,44943900	3,5405250000
03/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	313,29	138,46883600	2,2625307580
03/03/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	3.000.000,00	0,00	26.260,38908261	114,2405008000
03/03/2020	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.500.000,00	0,00	2.592,80131790	578,5248525000
03/03/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	564.129,70018763	3,5452840000
03/03/2020	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	2.000.000,00	0,00	834.359,59563597	2,3970480000
03/03/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	2.000.000,00	0,00	9.927,11034123	201,4684970000
03/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	243.877,12	66.342,94221964	3,6760070000
05/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	0,00	1.000.000,00	443.756,12938154	2,2534900000
05/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	400.000,00	176.739,04033500	2,2632237860
05/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	25,00	11,04619000	2,2632237860
05/03/2020	BB PREV ALOC FIC	0,00	3.500.000,00	2.377.963,01291327	1,4718479560
05/03/2020	MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	2.000.000,00	0,00	582.212,79930214	3,4351701000
05/03/2020	BB PREV IMA-B5+	3.900.000,00	0,00	1.140.590,91855300	3,4192802490
05/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	271.954,99471184	3,6770790000
06/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	33.181,03	9.022,72116062	3,6774970000
09/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	1.242,00	361,13123050	3,4391930000
10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	7.883,63	2.597,66752513	3,0348880000

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
11/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	136.547,00	0,00	37.116,23739909	3,6789020000
16/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.644,54	0,00	21.032,04311500	2,2653310350
17/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.137,00	0,00	17.423,77894727	3,6810040000
17/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	77.539,59	25.786,31036985	3,0070060000
18/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000,00	271,66021609	3,6810690000
19/03/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	2.000.000,00	167.268,58126243	11,9568181000
19/03/2020	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	2.000.000,00	0,00	697.353,88718829	2,8679843000
19/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.862.147,05	0,00	821.804,09951400	2,2659257250
20/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.533.167,95	0,00	1.503.018,29128333	3,6813710000
23/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.100,00	298,79677256	3,6814320000
23/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	1.600,00	553,36591736	2,8913960000
25/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.311.567,95	899.435,81014648	3,6818280000
25/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	81.759,91	27.841,55833896	2,9366140000
27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	31.175,00	10.544,30960731	2,9565710000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão





## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,32	11.737.907,40	2,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,03	0,14	2.854.973,30	0,59
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,06	0,78	2.822.594,00	0,58
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,06	0,77	5.666.260,00	1,17
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	-0,03	2.183.034,48	0,45
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	0,10	0,53	24.770.409,94	5,11
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,24	0,20	-0,66	90.519,17	0,02
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	2,70	0,23	-1,13	3.162.629,19	0,65
PIATÃ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	3,00	0,30	-0,20	1.991.116,55	0,41
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	5,99	0,78	3,47	10.955.055,04	2,26
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	6,57	0,62	-1,34	770.789,27	0,16
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,96	1,16	-1,71	1.304.856,03	0,27
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	14,33	1,41	-1,71	2.909.772,62	0,60
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	14,36	1,41	-1,79	23.038.818,37	4,76
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	27.050.747,76	5,58
BB PR IMA GERAL	Artigo 7º I, Alínea b	14,71	1,43	-2,01	4.316.691,55	0,89
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	15,12	1,48	-1,97	13.185.228,80	2,72
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	1,67	-0,13	7.549.866,06	1,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	16,19	1,67	-0,11	44.598,41	0,01
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	16,20	1,73	1,21	2.923.182,73	0,60
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	16,25	1,59	-2,07	6.173.224,94	1,27
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	16,96	1,66	-2,10	58.743.386,37	12,13
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	17,05	1,68	-1,89	6.280.098,66	1,30
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	17,85	1,76	-2,06	3.095.583,58	0,64
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	33,63	3,17	-6,65	2.257.569,85	0,47
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	34,78	3,28	-6,95	3.091.377,64	0,64
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	41.067.103,43	8,48
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	61.617.437,22	12,72
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	40,13	3,84	-6,70	1.071.046,67	0,22
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	41,23	3,99	-6,12	11.779.731,67	2,43

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	42,71	4,75	7,43	3.066.738,35	0,63
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	43,61	4,16	-7,55	17.877.098,68	3,69
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	50,81	4,58	-13,94	1.079.200,00	0,22
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	53,21	4,99	-10,89	3.466.273,73	0,72
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	54,07	5,06	-11,33	2.053.644,58	0,42
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	58,63	6,17	2,01	1.515.095,35	0,31
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	62,09	6,71	6,30	5.934.852,57	1,22
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	Artigo 8º III	85,06	8,10	-14,56	8.485.337,03	1,75
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	95,67	8,63	-24,62	517.050,00	0,11
BB Ações Dividendos	Artigo 8º II, Alínea a	103,70	9,16	-29,38	5.495.393,75	1,13
FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	106,44	9,57	-27,40	1.639.369,27	0,34
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	115,87	10,55	-27,45	6.382.773,06	1,32
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	118,33	10,48	-32,44	6.454.826,33	1,33
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	122,15	10,93	-31,64	14.132.859,65	2,92
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	122,33	10,95	-31,54	6.496.829,74	1,34
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	122,50	11,05	-30,29	1.250.943,33	0,26
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	122,57	11,22	-27,86	2.068.772,64	0,43
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	123,17	11,16	-29,71	8.702.561,79	1,80
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	124,36	11,18	-31,34	2.328.250,06	0,48
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	124,44	11,28	-29,93	3.896.557,18	0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	125,25	11,31	-30,69	2.113.930,88	0,44
FIA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	128,23	11,59	-31,23	1.820.780,90	0,38
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	128,96	11,23	-37,39	9.116.742,37	1,88
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	129,09	11,64	-31,71	5.059.497,30	1,04
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	132,15	11,73	-35,06	7.717.752,52	1,59
MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	141,04	12,55	-36,49	2.251.179,01	0,46
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	144,72	12,53	-41,88	3.782.040,59	0,78
FIA CONSTRUCAO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	154,81	13,63	-41,14	1.550.429,61	0,32

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

-Referente ao mês de março de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 16,74% do patrimônio líquido do fundo ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (Art. 9, Inciso II, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;