



**BALNEÁRIO CAMBORIÚ**  
JUNHO 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 02.12.2020.

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

70,23%

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	11,95	1,92	-1,58	2.364.628,20	0,44	194.393.504,74	1,22
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	4,92	1,07	3,10	3.016.985,09	0,56	1.349.967.643,25	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,35	2,00	-1,78	3.241.122,10	0,60	362.047.246,48	0,90
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	43.077.558,32	8,01	5.526.503.185,82	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	64.640.192,14	12,02	5.979.262.081,07	1,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,36	0,89	1,61	13.541.513,23	2,52	1.297.957.904,60	1,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,10	3,04	25.627.887,95	4,77	8.746.335.681,60	0,29
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,05	2,80	-5,95	3.667.940,71	0,68	1.945.603.761,59	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,24	0,87	1,50	4.430.851,12	0,82	551.577.372,01	0,80
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	0,77	4,73	46.082,02	0,01	17.164.831.993,69	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	1,08	3,08	23.893.208,02	4,44	4.025.627.854,04	0,59
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,09	1,20	3,53	3.226.794,85	0,60	288.951.700,68	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,30	0,99	1,64	789.280,42	0,15	683.688.528,70	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	1,75	60.483.447,62	11,25	10.783.491.196,95	0,56
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	7.797.028,08	1,45	12.211.119.756,17	0,06
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,15	2,11	-0,51	1.130.750,78	0,21	1.653.597.083,69	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,21	0,89	0,74	3.215.614,99	0,60	1.000.064.153,24	0,32
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,09	1,09	2,51	1.347.704,50	0,25	893.476.505,39	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,48	3,56	5.717.240,00	1,06	192.274.469,65	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,37	0,48	3,59	2.848.464,00	0,53	217.880.745,48	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,25	1,42	0,58	274.104.294,14	50,98		

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	0,07	0,20	1,65	3.796.297,67	0,71	8.258.927.944,74	0,05
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,21	1,99	-0,34	12.392.312,82	2,30	433.601.892,28	2,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,24	0,89	3.685.932,14	0,69	5.172.945.706,81	0,07
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,80	1,06	1,99	6.363.627,26	1,18	803.776.572,76	0,79
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,37	4.542.716,83	0,84	2.439.958.346,20	0,19
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,28	2,75	8,67	2.173.397,60	0,40	249.666.176,43	0,87
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	15,08	2,28	-1,30	18.911.924,22	3,52	847.771.239,55	2,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,44	2,27	25.048.666,70	4,66	5.170.951.886,47	0,48
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,47	0,70	6,50	7.068.182,94	1,31	967.981.853,65	0,73
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,14	0,37	5,44	11.081.031,99	2,06	795.231.088,18	1,39
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,04	1,14	3,99	6.401.577,16	1,19	83.187.747,62	7,70
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>5,70</b>	<b>1,08</b>	<b>1,77</b>	<b>101.465.667,33</b>	<b>18,87</b>		

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 FI RF LONGO PRAZO	32,44	0,71	-0,47	2.002.859,23	0,37	113.006.889,79	1,77
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>32,44</b>	<b>0,71</b>	<b>-0,47</b>	<b>2.002.859,23</b>	<b>0,37</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,52</b>	<b>1,33</b>	<b>0,87</b>	<b>377.572.820,70</b>	<b>70,23</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,43%

## 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	43,68	8,72	-17,82	6.244.490,29	1,16	328.154.273,23	1,90
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,22	8,61	-17,75	11.293.998,22	2,10	625.376.500,86	1,81
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>43,37</b>	<b>8,65</b>	<b>-17,80</b>	<b>17.538.488,51</b>	<b>3,26</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	42,84	8,72	-16,91	1.642.556,29	0,31	16.584.453,42	9,90
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	43,05	8,95	-24,53	8.157.268,72	1,52	671.878.055,53	1,21
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	46,52	13,39	-25,06	14.313.074,62	2,66	444.267.217,52	3,22
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	37,97	6,59	-22,29	8.876.098,99	1,65	907.675.512,87	0,98
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	40,48	5,36	-22,26	7.675.297,82	1,43	1.863.872.898,82	0,41
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	42,99	8,50	-15,58	18.650.973,74	3,47	1.989.712.475,16	0,94
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,37	8,62	-16,61	3.045.560,56	0,57	769.821.540,22	0,40
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	58,78	18,16	-35,07	1.982.670,04	0,37	489.413.926,39	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	44,99	10,27	-8,33	7.167.649,09	1,33	2.091.503.187,63	0,34
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,81	8,04	-17,46	2.730.845,10	0,51	997.483.211,36	0,27
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	43,32	8,30	-13,97	2.694.436,25	0,50	1.017.291.231,01	0,26
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,13	9,80	-17,46	2.525.012,04	0,47	672.088.502,03	0,38
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	1.976.586,13	0,37	799.344.501,83	0,25
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,24	12,89	-21,45	10.161.822,72	1,89	1.090.602.347,47	0,93
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	42,89	9,28	-22,25	8.251.451,45	1,53	3.271.734.214,80	0,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	50,97	12,10	-28,51	5.053.236,03	0,94	1.785.775.187,89	0,28
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	54,39	12,73	63,94	3.465.785,62	0,64	1.036.661.356,41	0,33
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>43,49</b>	<b>9,75</b>	<b>-20,29</b>	<b>108.370.325,21</b>	<b>20,16</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 MULTIMERCADO	31,93	0,91	-5,88	11.099.105,37	2,06	449.269.476,57	2,47
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>31,93</b>	<b>0,91</b>	<b>-5,88</b>	<b>11.099.105,37</b>	<b>2,06</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 FIC DE FIP	65,89	-0,91	-2,08	847.360,62	0,16	14.726.151,34	5,75
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	32,11	3,26	-6,91	2.374.767,45	0,44	127.132.151,28	1,87
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>29,09</b>	<b>2,07</b>	<b>-5,58</b>	<b>3.222.128,07</b>	<b>0,60</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	FI IMOBILIÁRIO THE ONE	26,66	5,58	-19,68	1.147.600,00	0,21	140.591.634,05	0,82
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	51,35	5,29	-33,71	617.013,00	0,11	589.277.421,50	0,10
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,60	0,38	-33,46	88.681,56	0,02	15.248.025,09	0,58
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>38,58</b>	<b>5,22</b>	<b>-25,66</b>	<b>1.853.294,56</b>	<b>0,34</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>40,05</b>	<b>8,62</b>	<b>-18,75</b>	<b>142.083.341,72</b>	<b>26,43</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,35%

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	25,90	5,79	31,21	1.968.195,44	0,37	13.164.598,04	14,95
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,35	7,69	36,88	7.610.108,45	1,42	306.230.783,51	2,49
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>32,87</b>	<b>7,26</b>	<b>35,42</b>	<b>9.578.303,89</b>	<b>1,78</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	26,27	4,37	32,85	8.416.209,29	1,57	1.181.944.568,52	0,71
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>26,27</b>	<b>4,37</b>	<b>32,85</b>	<b>8.416.209,29</b>	<b>1,57</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>23,88</b>	<b>5,86</b>	<b>37,19</b>	<b>17.994.513,18</b>	<b>3,35</b>		
<b>Total</b>			<b>14,36</b>	<b>3,33</b>	<b>-4,25</b>	<b>537.650.675,60</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	274.104.294,14	50,98	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	101.465.667,33	18,87	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.002.859,23	0,37	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	377.572.820,70	70,23				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	17.538.488,51	3,26	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	108.370.325,21	20,16	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	11.099.105,37	2,06	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.222.128,07	0,60	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.853.294,56	0,34	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	142.083.341,72	26,43				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	9.578.303,89	1,78	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.416.209,29	1,57	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.994.513,18	3,35				



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

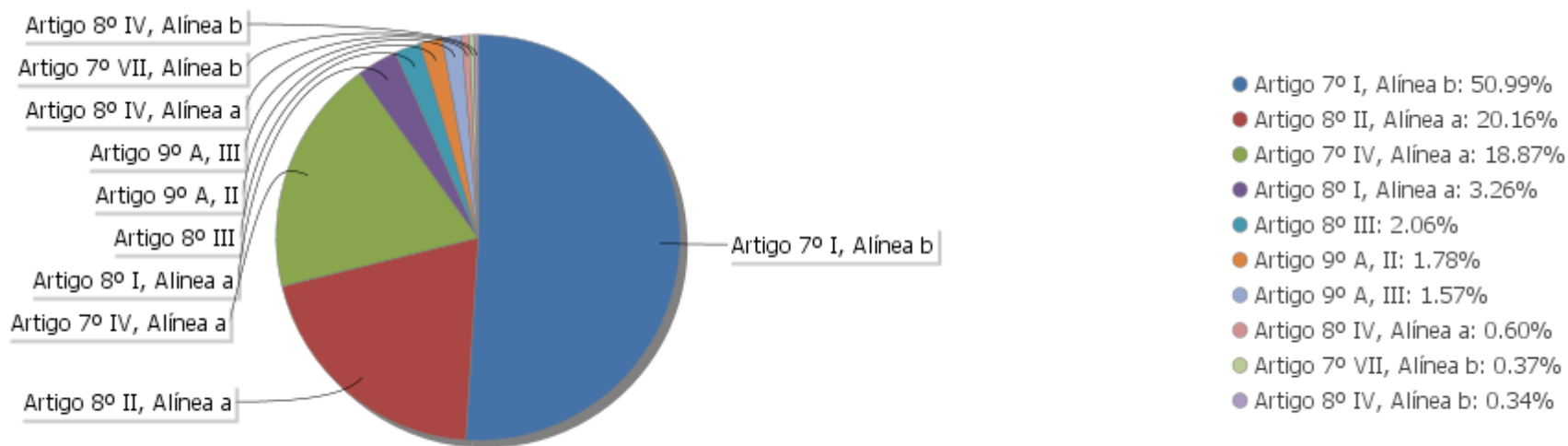
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,42 670,37	0,58 32,87	3,87 526,73	0,58 32,87	6,18 134,28	3.846.800,50	1.666.434,87
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,08 509,90	1,77 100,64	2,96 402,53	1,77 100,64	6,86 148,93	1.085.677,36	1.996.471,18
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,71 336,32	-0,47 -26,53	0,59 80,26	-0,47 -26,53	33,72 732,46	14.200,99	-10.130,71
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,65 -0,11	-17,80 0,00	29,87 -0,30	-17,80 0,00	-6,01 -0,15	1.396.246,12	-2.935.194,63
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,75 0,99	-20,29 -2,48	30,20 0,03	-20,29 -2,48	-4,50 1,35	9.626.232,67	-25.672.674,06
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,91 -7,85	-5,88 11,92	18,57 -11,61	-5,88 11,92	4,57 10,43	99.812,86	-451.687,64
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,07 -6,68	-5,58 12,23	-11,75 -41,92	-5,58 12,23	-9,20 -3,35	66.676,20	-189.712,95
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	5,22 -3,53	-25,66 -7,86	9,92 -20,26	-25,66 -7,86	-0,36 5,50	92.009,41	-640.208,13
Artigo 9º A, II % do CDI	7,26 3.417,76	35,42 3.395,37	33,00 4.490,48			667.015,68	2.078.303,89
Artigo 9º A, III % do CDI	4,37 2.057,88	32,85 1.872,61	24,40 3.320,23	32,85 1.872,61	54,59 1.185,93	352.345,78	1.772.339,29
<b>BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)</b>						<b>17.247.017,57</b>	<b>-22.386.058,89</b>

### Análise de Liquidez

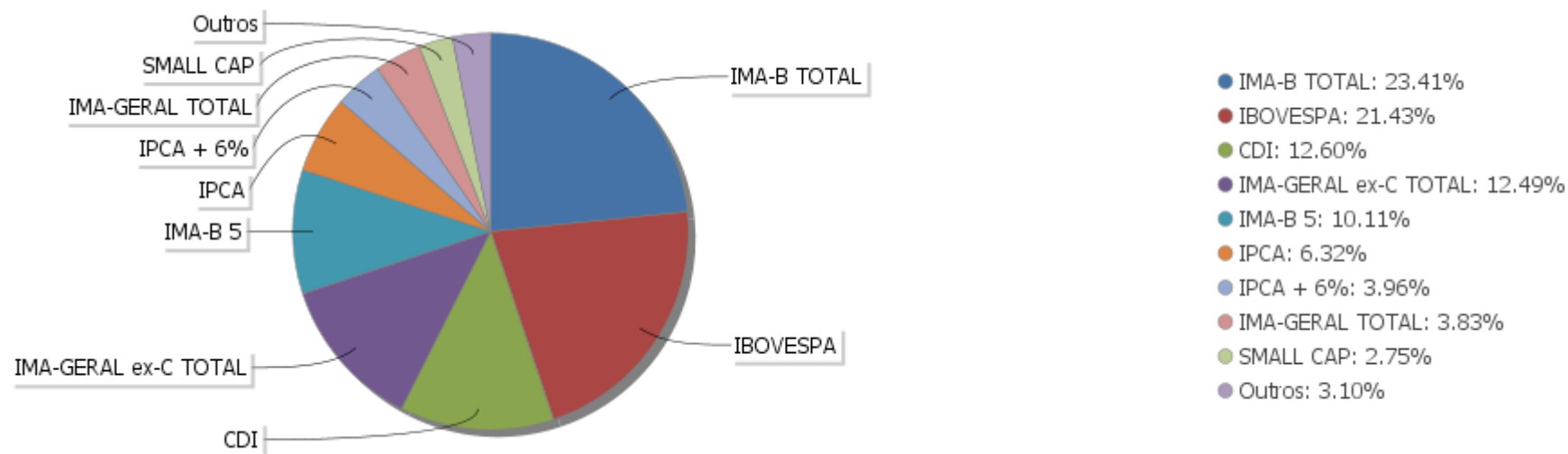
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	498.523.700,51	92,72	498.523.700,51	92,72
de 31 a 364 dias	22.820.968,02	4,24	521.344.668,53	96,97
acima de 365 dias	16.306.007,07	3,03	537.650.675,60	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

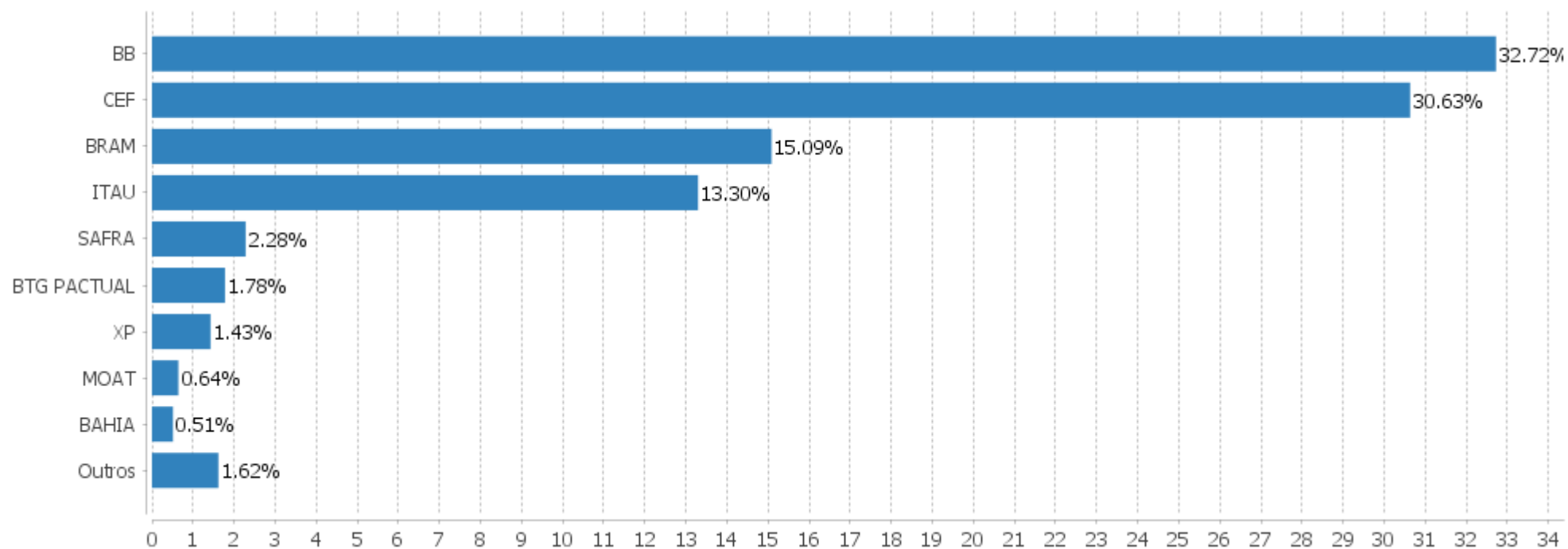


### Alocação Por Estratégia



## 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	3,35	2,61	3,33							-4,25
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,92
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59							-7,17
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

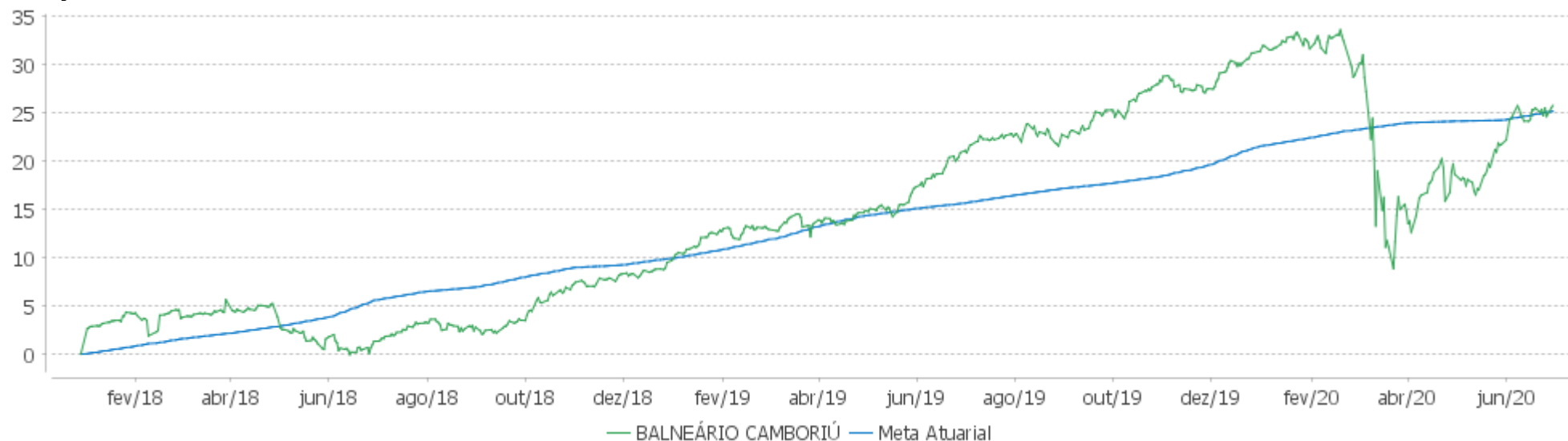
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	17	56,67	03 meses	9,58	0,95	8,62	11,84
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	43,33	06 meses	-4,25	2,92	-7,17	20,09
			12 meses	4,05	8,22	-4,17	14,36
			24 meses	24,14	18,49	5,64	10,62
			36 meses				
Desde 29/12/2017				25,79	25,11	0,68	10,03

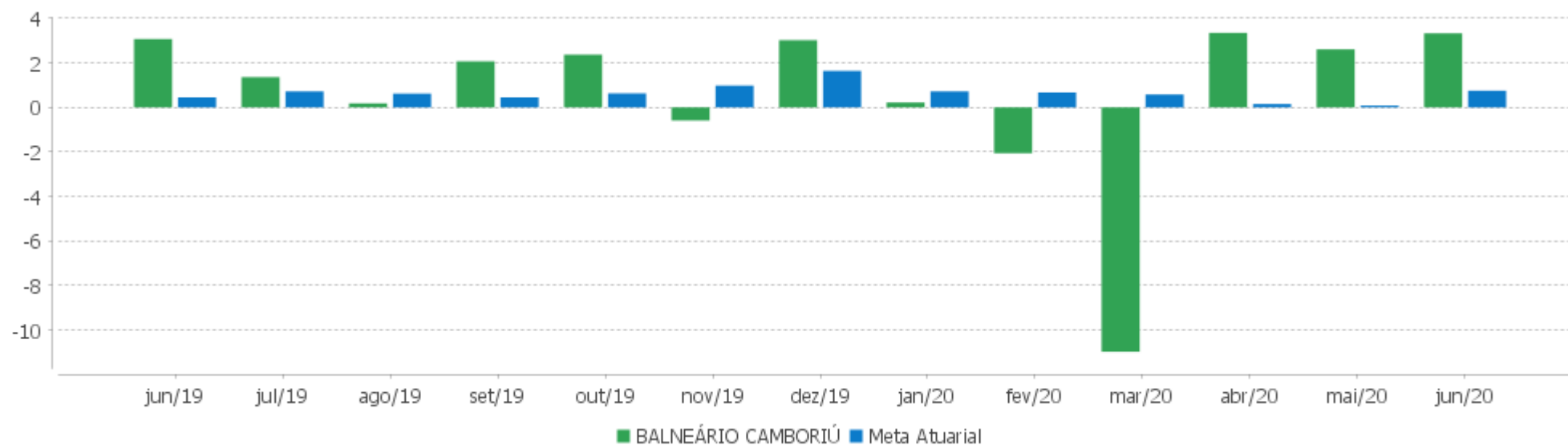
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2018-01
Menor rentabilidade da Carteira	-10,98	2020-03

## 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 FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,71 336,32	-0,47 -26,53	0,59 80,26	-0,47 -26,53	33,72 732,46	31,35 279,58	-22,96 -118,40
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	2,28 1.073,05	-1,30 -74,09	5,79 787,73	-1,30 -74,09	5,55 120,62	37,94 338,34	50,51 260,47
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	1,99 938,88	-0,34 -19,33	5,20 707,68	-0,34 -19,33	6,72 145,89	38,42 342,63	49,17 253,57
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,70 330,08	6,50 370,64	3,14 427,36	6,50 370,64	11,48 249,34	28,06 250,21	41,54 214,22
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,20 94,05	1,65 93,89	0,69 93,50	1,65 93,89	4,41 95,70	10,82 96,46	18,80 96,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 122,46	1,37 78,16	0,78 105,60	1,37 78,16	4,06 88,25	10,51 93,70	18,70 96,43
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,24 114,33	1,37 78,02	0,58 78,30	1,37 78,02	4,03 87,52	10,44 93,15	18,40 94,90
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6% p.p.	1,14 0,39	3,99 1,00	4,50 3,52	3,99 1,00	10,09 1,80	36,15 17,58	
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI	0,37 173,45	5,44 310,26	1,15 156,49	5,44 310,26	10,30 223,82		
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	2,75 -0,09	-5,91 -0,65	5,83 -0,16	-5,91 -0,65	1,12 -0,86	41,71 -1,85	49,98 -2,35
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,06 0,07	1,99 0,12	3,08 0,20	1,99 0,12	6,59 0,07	23,83 0,38	34,28 0,38
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,44 0,18	2,27 2,17	1,12 1,55	2,27 2,17	5,62 3,49	19,25 13,67	31,68 21,48
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,20 -0,85	3,53 5,20	4,24 -0,72	3,53 5,20	9,39 4,45	29,75 -5,38	42,26 -3,95
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,10 -0,02	3,04 -0,13	3,71 -0,06	3,04 -0,13	8,51 -0,30	24,21 -0,55	35,98 -0,92
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,07 -0,05	3,10 -0,07	3,68 -0,08	3,10 -0,07	8,64 -0,18	24,11 -0,65	35,63 -1,27
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,08	3,08	3,71	3,08	8,59	24,25	36,09

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 5 p.p.	-0,04	-0,09	-0,06	-0,09	-0,22	-0,51	-0,81
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	1,92	-1,58	4,74	-1,58	4,81	34,49	45,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,12	0,08	-0,22	0,08	-0,14	-0,63	-1,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,77	4,73	3,33	4,73	9,54	26,59	37,48
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,13	-0,06	-0,13	-0,27	-0,49	-0,96
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,09	2,51	3,28	2,51	7,73	29,33	42,34
Var. INPC + 6% p.p.	0,30	-0,74	2,05	-0,74	-0,79	10,58	12,11
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,89	1,61	2,70	1,61	6,10	22,48	32,23
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,09	-0,26	-0,19	-0,26	-0,42	-0,97	-1,67
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89	0,74	1,68	0,74	4,90	15,30	24,27
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,16	2,40	-3,28	2,40	-0,05	-19,83	-21,94
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	3,56	0,90	3,56	8,30	19,49	27,50
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,27	0,57	-0,08	0,57	0,02	0,92	-3,60
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	2,11	-0,51	5,57	-0,51	6,47		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06	1,15	0,62	1,15	1,52		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2,00	-1,78	4,84	-1,78	4,69	34,14	44,48
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,12	-0,12	-0,12	-0,25	-0,99	-1,73
BB PREV RF VII	0,99	1,64	2,40	1,64	6,28	19,00	30,65
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,06	3,31	-2,56	3,31	1,33	-16,13	-15,55
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,95	1,75	2,96	1,75	6,31	23,29	33,67
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,05	0,04	0,22	0,04	-0,01	0,35	0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,75	4,63	3,27	4,63	9,82	28,20	38,61
Var. IPCA p.p.	0,49	4,53	3,70	4,53	7,69	22,63	28,41
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,02	-1,75	4,90	-1,75	4,74	34,48	45,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,08	-0,06	-0,08	-0,20	-0,65	-1,09
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,48	3,59	0,92	3,59	8,38	19,65	27,71
Var. INPC + 6% p.p.	-0,31	0,34	-0,32	0,34	-0,14	0,90	-2,52
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,87	1,50	2,64	1,50	6,00	22,30	32,10
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,03	-0,21	-0,09	-0,21	-0,32	-0,64	-1,01
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,80	-5,38	5,82	-5,38	1,87	42,80	51,23
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04	-0,11	-0,17	-0,11	-0,10	-0,75	-1,10
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	13,39	-25,06	30,82	-25,06	-2,60	34,82	48,71
Var. SMALL CAP p.p.	-1,04	-4,33	-1,67	-4,33	-7,75	-14,19	-21,12
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	8,30	-13,97	30,24	-13,97	3,76	48,79	98,86
Var. IBOVESPA p.p.	-0,45	3,84	0,07	3,84	9,62	18,15	47,73
BRADESCO F I A SELECTION	8,95	-24,53	25,56	-24,53	-13,47	19,34	54,11



# 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.	0,20	-6,73	-4,62	-6,73	-7,62	-11,30	2,98
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	12,10 3,34	-28,51 -10,71	33,61 3,43	-28,51 -10,71	-13,13 -7,28	23,01 -7,63	52,90 1,78
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,04 -0,71	-17,46 0,34	29,18 -0,99	-17,46 0,34	-4,65 1,20	30,74 0,10	62,43 11,31
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	18,16 8.554,49	-30,30 -1.727,04	27,88 3.793,85	-30,30 -1.727,04	-5,62 -121,99	53,28 475,19	40,71 209,95
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9,28	-22,25	27,83	-22,25	-4,41	36,54	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,58 -4,37	-16,79 1,59	20,57 1,87	-16,79 1,59	-2,34 -2,18	45,78 -1,73	57,70 -2,87
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO Var. IBRX 100 p.p.	8,72 -0,25	-16,04 1,34	31,31 0,92	-16,04 1,34	-2,20 2,46	37,50 3,29	66,66 12,77
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,36 -3,59	-22,26 -3,88	20,25 1,55	-22,26 -3,88	-14,42 -14,26	19,49 -28,03	37,01 -23,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,27 1,52	-8,33 9,47	41,67 11,49	-8,33 9,47	8,82 14,67	55,69 25,05	80,75 29,62
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	9,80 -0,28	-11,31 -0,41	38,68 -0,77	-11,31 -0,41	14,47 0,49	49,71 -3,23	49,56 -5,66
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	12,73 3,97	63,94 24,83	53,95 23,78				
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	12,89 4,14	-21,45 -3,65	31,67 1,49	-21,45 -3,65	3,57 9,43	42,14 11,50	61,19 10,06
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	8,62 -0,14	-16,61 1,19	30,81 0,63	-16,61 1,19	-1,66 4,19	35,75 5,11	55,33 4,21
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	6,59 -2,17	-22,29 -4,49	21,06 -9,12	-22,29 -4,49	-12,10 -6,25	24,15 -6,49	32,50 -18,62
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,50 -0,26	-15,58 2,22	31,97 1,79	-15,58 2,22	6,25 12,11	52,81 22,17	84,44 33,32
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	8,61 -0,15	-17,75 0,06	29,78 -0,40	-17,75 0,06	-5,96 -0,11	29,82 -0,82	49,23 -1,90
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	8,72 -0,03	-17,94 -0,13	30,06 -0,12	-17,94 -0,13	-6,10 -0,25	30,29 -0,35	49,96 -1,17
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,91 -7,85	-5,88 11,92	18,57 -11,61	-5,88 11,92	4,57 10,43	17,16 -13,48	38,64 -12,48
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6% p.p.	-0,91 -1,65	-2,08 -5,06	0,68 -0,30	-2,08 -5,06	13,59 5,31	144,85 126,29	166,44 135,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIP CAIXA CYRELA Var. IBOVESPA p.p.	3,26 -5,50	-6,91 10,90	-15,72 -45,90	-6,91 10,90	-17,76 -11,91	-14,02 -44,66	
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII Var. IFIX p.p.	0,38 -5,21	-33,46 -21,23	-1,26 -13,78	-33,46 -21,23	-40,99 -47,85	-48,42 -80,47	
FI IMOBILIÁRIO THE ONE Var. IFIX p.p.	5,58 -0,01	-19,68 -7,44	6,34 -6,18	-19,68 -7,44	2,55 -4,31	17,97 -14,08	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA Var. IFIX p.p.	5,29 -0,30	-33,71 -21,47	19,33 6,82	-33,71 -21,47	4,68 -2,18	19,33 -12,71	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	5,79 -2,96	48,44 66,25	29,91 -0,27	48,44 66,25	67,98 73,84		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	7,69 6,94	51,88 48,89	33,90 32,92	51,88 48,89			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	4,37 -4,39	32,85 50,66	24,40 -5,78	32,85 50,66	54,59 60,44	66,72 36,08	118,22 67,09
BALNEÁRIO CAMBORIÚ Var. IPCA + 6% p.p.	3,33 2,58	-4,25 -7,24	9,58 8,59	-4,25 -7,24	4,05 -4,24	24,14 5,57	
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

## 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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,22	19,40
<b>Meta Atuarial</b>							

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

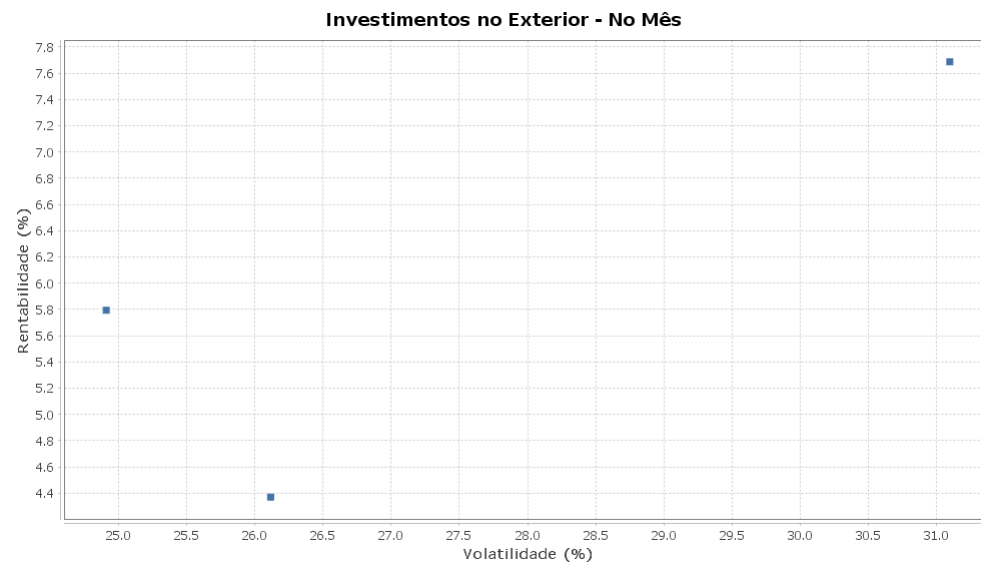
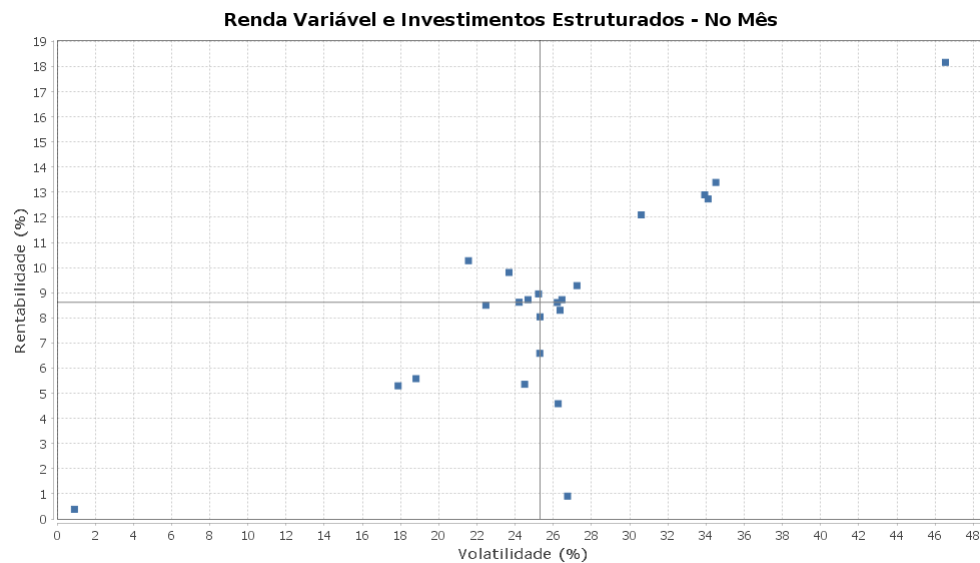
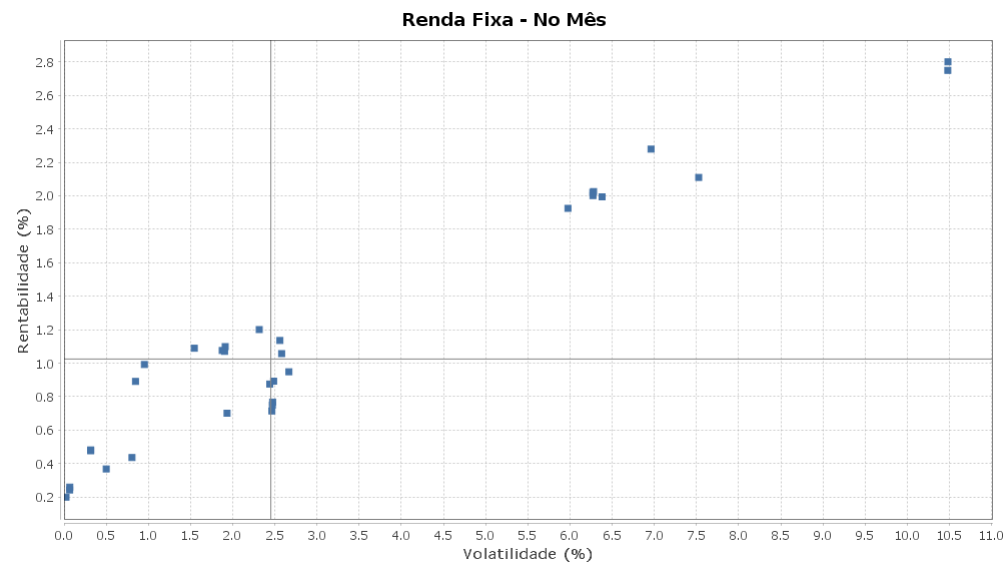
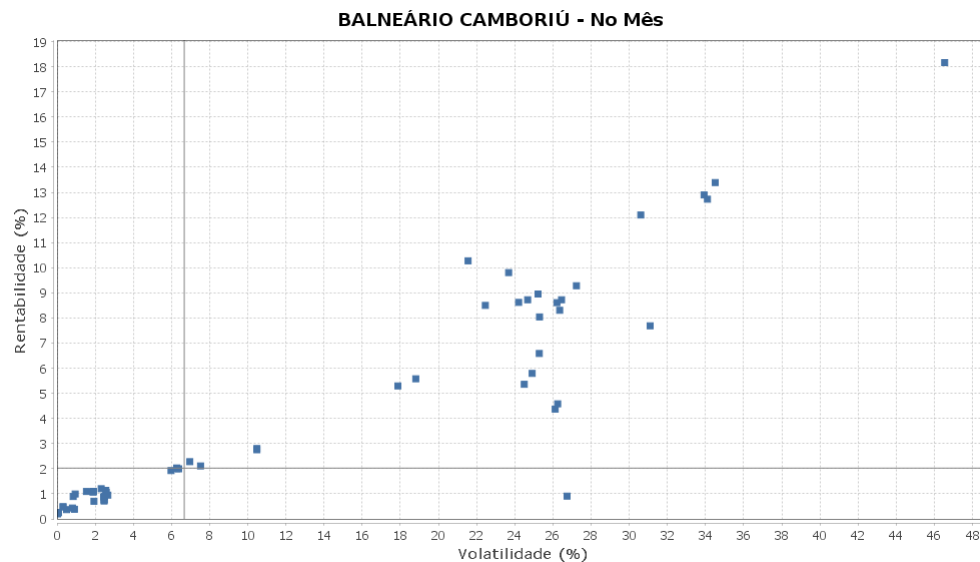
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
260	01/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	231.022,23	62.562,88996490	3,6926400000
261	01/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	824.735,55	223.345,77700507	3,6926400000
275	01/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	185.000,00	50.099,65769747	3,6926400000
276	01/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000,00	541,61792105	3,6926400000
262	02/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	270.759,76000938	3,6933110000
277	02/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.090,00	565,88789842	3,6933110000
287	03/06/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	6.997,08055141	142,9167483000
279	03/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	21.592,00	5.845,37742237	3,6938590000
259	05/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.644,54	0,00	20.949,80644400	2,2742233980
263	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	240.743,39	0,00	65.158,71149204	3,6947230000
264	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	111.577,66	30.199,19490582	3,6947230000
280	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.900,00	1.867,52836410	3,6947230000
281	10/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	16.900,00	4.572,41185256	3,6960800000
256	16/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.900.339,78	0,00	834.989,20167000	2,2758854560
265	16/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	905.992,96	245.042,17408732	3,6972940000
282	16/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	270.468,07746422	3,6972940000
266	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	750.000,00	0,00	202.795,71468319	3,6983030000
283	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	17.668,82	4.777,54797268	3,6983030000
267	19/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.016.328,50	0,00	1.085.865,14420061	3,6987360000
268	19/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	940.217,34	0,00	254.199,63468601	3,6987360000
269	24/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	130.952,21	35.396,98556303	3,6995300000
270	24/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.653,40	446,92163599	3,6995300000
284	24/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	84.612,18	22.871,06199977	3,6995300000
285	24/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.100,00	297,33506689	3,6995300000
253	26/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	127.519,71	0,00	55.973,58927900	2,2782121290
257	26/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.438.411,53	0,00	1.509.258,72364100	2,2782121290
271	26/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.438.411,53	929.210,50611860	3,7003580000
272	26/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	127.519,71	34.461,45210815	3,7003580000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
254	29/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	75.000,00	32.917,75838200	2,2784054470
258	29/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.438.411,53	1.509.130,66615500	2,2784054470
273	29/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000,00	270,21454765	3,7007630000
286	29/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	26.000,00	7.025,57823887	3,7007630000
255	30/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	75.000,00	0,00	32.914,15820200	2,2786546610
274	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	12.400,00	3.350,26568417	3,7011990000
Total						

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	-0,00	-0,53	0,20	3.796.297,67	0,71
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,46	0,24	3.685.932,14	0,69
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,11	-0,00	0,70	0,26	4.542.716,83	0,84
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,32	0,10	-0,00	0,84	0,48	5.717.240,00	1,06
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,32	0,10	-0,00	0,85	0,48	2.848.464,00	0,53
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,50	1,16	-0,01	0,31	0,37	11.081.031,99	2,06
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,81	0,54	0,01	0,28	0,44	25.048.666,70	4,66
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,85	0,61	0,00	0,80	0,89	3.215.614,99	0,60
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,91	1,26	0,00	0,19	0,38	88.681,56	0,02
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,95	1,62	0,00	0,82	0,99	789.280,42	0,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	2,48	0,00	0,57	1,09	1.347.704,50	0,25
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,88	2,40	0,09	0,46	1,08	23.893.208,02	4,44
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,90	2,86	0,01	0,45	1,07	3.016.985,09	0,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	2,89	0,11	0,46	1,10	25.627.887,95	4,77
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	1,93	3,03	0,03	0,25	0,70	7.068.182,94	1,31
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,31	3,31	0,02	0,43	1,20	3.226.794,85	0,60
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	3,58	0,03	0,27	0,87	4.430.851,12	0,82
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	2,46	0,05	0,00	0,20	0,71	2.002.859,23	0,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	2,80	0,03	0,22	0,75	7.797.028,08	1,45
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	2,80	0,00	0,22	0,77	46.082,02	0,01
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,49	3,68	0,08	0,27	0,89	13.541.513,23	2,52
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	2,56	3,72	0,04	0,36	1,14	6.401.577,16	1,19
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,58	3,74	0,04	0,33	1,06	6.363.627,26	1,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	3,94	0,39	0,28	0,95	60.483.447,62	11,25
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,97	9,38	0,04	0,29	1,92	2.364.628,20	0,44
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	9,57	0,69	0,29	2,02	43.077.558,32	8,01
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	9,71	0,05	0,29	2,00	3.241.122,10	0,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	9,76	1,06	0,29	2,03	64.640.192,14	12,02
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,38	9,50	0,20	0,28	1,99	12.392.312,82	2,30
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,96	11,31	0,36	0,30	2,28	18.911.924,22	3,52



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	7,53	9,93	0,02	0,25	2,11	1.130.750,78	0,21
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	10,48	14,17	0,05	0,24	2,75	2.173.397,60	0,40
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,48	14,39	0,09	0,25	2,80	3.667.940,71	0,68
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	17,87	0,72	0,00	0,28	5,29	617.013,00	0,11
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	18,81	0,53	0,00	0,29	5,58	1.147.600,00	0,21
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,55	30,10	0,39	0,47	10,27	7.167.649,09	1,33
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,46	28,73	0,96	0,37	8,50	18.650.973,74	3,47
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	23,68	31,59	0,14	0,41	9,80	2.525.012,04	0,47
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,20	30,27	0,17	0,35	8,62	3.045.560,56	0,57
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	24,50	30,99	0,43	0,21	5,36	7.675.297,82	1,43
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	24,67	31,33	0,09	0,34	8,72	1.642.556,29	0,31
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,91	20,56	0,04	0,22	5,79	1.968.195,44	0,37
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	25,22	30,47	0,44	0,35	8,95	8.157.268,72	1,52
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	25,29	27,02	0,43	0,25	6,59	8.876.098,99	1,65
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,30	30,15	0,15	0,31	8,04	2.730.845,10	0,51
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,12	19,78	0,17	0,16	4,37	8.416.209,29	1,57
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	26,21	32,03	0,65	0,32	8,61	11.293.998,22	2,10
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	28,36	0,10	0,17	4,58	1.976.586,13	0,37
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,35	32,89	0,16	0,31	8,30	2.694.436,25	0,50
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	26,45	32,54	0,37	0,32	8,72	6.244.490,29	1,16
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	26,74	22,12	0,37	0,03	0,91	11.099.105,37	2,06
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	27,24	29,79	0,44	0,33	9,28	8.251.451,45	1,53
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	30,61	34,93	0,32	0,39	12,10	5.053.236,03	0,94
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	31,10	17,64	0,03	0,24	7,69	7.610.108,45	1,42
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	33,93	29,54	0,54	0,37	12,89	10.161.822,72	1,89
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	34,10	26,99	0,16	0,37	12,73	3.465.785,62	0,64
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	34,51	28,81	0,74	0,38	13,39	14.313.074,62	2,66
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	46,54	39,07	0,13	0,39	18,16	1.982.670,04	0,37

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O Instituto está com 5,75% do patrimônio líquido do fundo GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;