



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
JULHO 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

69,35%

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 TESOUREO IPCA GERAL FI RF	12,02	4,15	2,51	2.462.842,76	0,44	220.829.373,24	1,12
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	4,92	0,97	4,11	3.046.358,82	0,54	1.357.961.719,18	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,43	4,36	2,50	3.382.475,03	0,60	371.400.916,61	0,91
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,47	4,36	2,54	44.956.797,09	8,03	5.823.784.558,48	0,77
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,54	4,38	2,42	67.468.208,81	12,06	6.313.416.954,01	1,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,38	1,65	3,29	9.727.424,47	1,74	1.311.603.752,58	0,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,97	4,05	25.877.398,59	4,62	12.027.903.790,65	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,21	7,28	0,89	3.934.894,82	0,70	2.088.485.812,29	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,26	1,67	3,19	4.504.827,55	0,80	554.105.395,70	0,81
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,85	1,09	5,87	46.583,95	0,01	15.544.114.121,31	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,97	4,08	29.145.048,85	5,21	4.153.926.563,49	0,70
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,10	1,12	4,69	3.262.853,03	0,58	292.180.623,88	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,29	0,32	1,97	791.806,83	0,14	685.876.947,75	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	40.331.402,54	7,21	10.799.663.748,52	0,37
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,98	5,65	12.912.763,74	2,31	12.451.209.797,34	0,10
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,24	4,81	4,27	1.185.107,47	0,21	1.804.759.615,69	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,19	0,07	0,81	3.217.883,57	0,57	1.000.769.936,56	0,32
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,08	0,72	3,25	1.357.466,57	0,24	899.948.386,83	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,86	4,45	5.766.632,00	1,03	193.935.673,94	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,37	0,87	4,49	2.873.246,00	0,51	219.776.387,60	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,28	2,68	3,27	266.252.022,49	47,58		

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	0,18	1,83	3.803.071,52	0,68	7.404.125.715,14	0,05
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,27	4,43	4,08	12.941.844,20	2,31	579.735.064,46	2,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,25	1,14	9.001.923,91	1,61	4.665.137.027,34	0,19
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,82	1,86	3,90	3.448.848,05	0,62	793.683.917,20	0,43
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,24	1,61	10.541.589,18	1,88	2.412.408.451,26	0,44
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,44	7,33	16,64	2.332.731,74	0,42	277.273.059,94	0,84
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	15,15	4,62	3,26	24.906.429,90	4,45	894.303.423,23	2,79
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,64	0,55	2,83	25.186.808,36	4,50	5.186.154.771,17	0,49
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,50	0,90	7,46	10.160.073,76	1,82	857.509.386,24	1,18
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,12	0,07	5,52	11.088.701,99	1,98	787.745.936,74	1,41
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,04	1,11	5,15	6.472.794,94	1,16	84.113.214,36	7,70
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,72	1,95	3,75	119.884.817,55	21,42		

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	32,54	-1,15	-1,61	1.951.801,07	0,35	112.078.175,54	1,74
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			32,54	-1,15	-1,61	1.951.801,07	0,35		
Renda Fixa			7,55	2,45	3,35	388.088.641,11	69,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,18%

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	44,00	8,22	-11,07	6.757.691,50	1,21	372.539.283,20	1,81
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,54	8,14	-11,05	12.213.575,64	2,18	692.799.908,03	1,76
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,69	8,17	-11,09	18.971.267,14	3,39		

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	43,12	8,42	-9,91	1.780.904,66	0,32	17.302.434,95	10,29
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	43,38	10,05	-16,95	8.976.674,68	1,60	711.621.761,40	1,26
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	46,78	10,14	-17,47	15.763.748,76	2,82	524.158.288,57	3,01
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,20	6,77	-17,03	9.476.848,85	1,69	972.576.793,16	0,97
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	40,82	7,15	-16,70	8.224.276,41	1,47	1.935.501.908,96	0,42
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,20	8,23	-8,64	20.185.910,43	3,61	2.138.402.416,21	0,94
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,61	8,46	-9,56	3.303.309,28	0,59	837.484.283,03	0,39
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	59,15	6,94	-30,57	2.120.196,23	0,38	575.045.117,36	0,37
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,16	8,38	-0,65	7.768.030,64	1,39	2.366.861.217,15	0,33
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,13	10,35	-8,92	3.013.465,92	0,54	1.108.758.492,93	0,27
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	43,69	8,78	-6,42	2.930.915,77	0,52	1.102.899.208,45	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,40	7,41	-11,34	2.712.176,80	0,48	737.824.163,56	0,37
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,01	8,32	-9,87	2.140.960,83	0,38	862.156.434,48	0,25
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,49	9,27	-14,17	11.104.292,92	1,98	1.227.996.315,01	0,90
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,06	7,54	-16,38	8.873.403,00	1,59	3.482.474.100,00	0,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	51,34	5,80	-24,37	5.346.203,33	0,96	1.851.616.977,67	0,29
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	47,89	12,54	84,50	3.900.480,79	0,70	1.171.659.129,94	0,33
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,74	8,54	-13,48	117.621.799,30	21,02		

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	32,09	5,58	-0,63	11.718.821,43	2,09	486.942.789,33	2,41
Sub-total Artigo 8º III			32,09	5,58	-0,63	11.718.821,43	2,09		

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	-0,02	-2,10	847.152,42	0,15	13.067.326,66	6,48
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	89,31	-26,67	-31,73	1.149.828,31	0,21	127.132.151,28	0,90
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			64,44	-14,52	-19,29	1.996.980,73	0,36		

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	26,85	-3,19	-22,24	1.110.968,00	0,20	140.640.213,56	0,79
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	51,53	-4,25	-36,52	590.815,80	0,11	588.833.314,78	0,10
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,61	0,75	-32,96	89.349,14	0,02	15.362.809,44	0,58
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			38,73	-3,35	-28,15	1.791.132,94	0,32		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,38	7,95	-12,29	152.100.001,54	27,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,48%

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	26,55	1,87	33,66	2.004.925,29	0,36	57.311.909,74	3,50
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,78	3,31	41,41	8.869.703,77	1,58	430.849.446,69	2,06
Sub-total Artigo 9º A, II			31,95	2,99	39,47	10.874.629,06	1,94		

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	26,66	1,88	35,34	8.574.013,83	1,53	1.279.266.331,34	0,67
Sub-total Artigo 9º A, III			26,66	1,88	35,34	8.574.013,83	1,53		
Investimentos no Exterior			24,57	2,44	40,54	19.448.642,89	3,48		
Total			14,47	3,90	-0,51	559.637.285,54	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	266.252.022,49	47,58	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	119.884.817,55	21,42	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.951.801,07	0,35	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	388.088.641,11	69,35				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	18.971.267,14	3,39	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	117.621.799,30	21,02	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	11.718.821,43	2,09	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.996.980,73	0,36	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.791.132,94	0,32	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	152.100.001,54	27,18				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	10.874.629,06	1,94	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.574.013,83	1,53	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.448.642,89	3,48				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

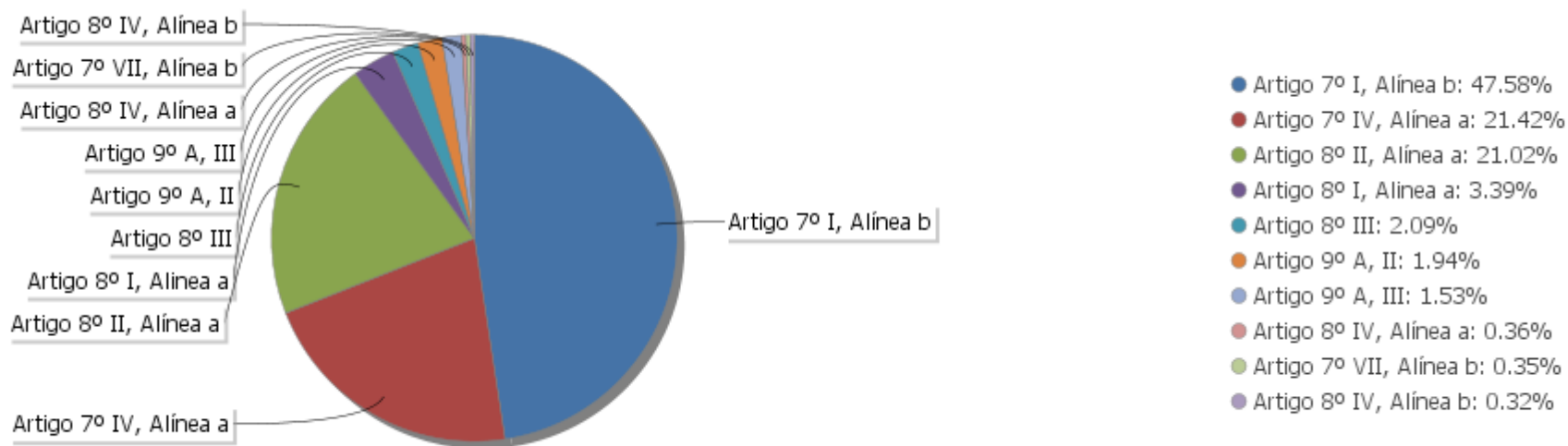
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,68 1.380,22	3,27 167,74	5,64 875,98	2,80 178,54	7,79 184,80	7.147.728,35	8.814.163,22
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,95 1.001,99	3,75 191,95	4,07 632,48	3,35 213,60	7,75 183,90	2.139.495,27	4.135.966,45
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-1,15 -591,26	-1,61 -82,43	-0,58 -89,78	-0,84 -53,68	32,36 767,77	-22.484,31	-32.615,02
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,17 -0,10	-11,09 -0,07	27,52 -0,31	-9,57 -0,04	0,86 -0,22	1.432.778,63	-1.502.416,00
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,54 0,27	-13,48 -2,47	26,97 -0,87	-13,48 -3,95	0,88 -0,20	9.251.474,09	-16.421.199,97
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,58 -2,68	-0,63 10,38	12,06 -15,77	-0,99 8,54	8,83 7,75	619.716,06	168.028,42
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-14,52 -22,78	-19,29 -8,28	-12,89 -40,72	-21,98 -12,44	-25,05 -26,13	-3.172,91	-192.885,86
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-3,35 -11,62	-28,15 -17,14	2,87 -24,96	-14,67 -5,13	-3,79 -4,87	-62.161,62	-702.369,75
Artigo 9º A, II % do CDI	2,99 1.539,53	39,47 3.184,32	16,15 2.509,07			296.325,17	2.374.629,06
Artigo 9º A, III % do CDI	1,88 964,81	35,34 1.810,52	9,28 1.441,94	27,06 1.724,07	55,47 1.316,13	157.804,54	1.930.143,83
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						20.957.503,27	-1.428.555,62

Análise de Liquidez

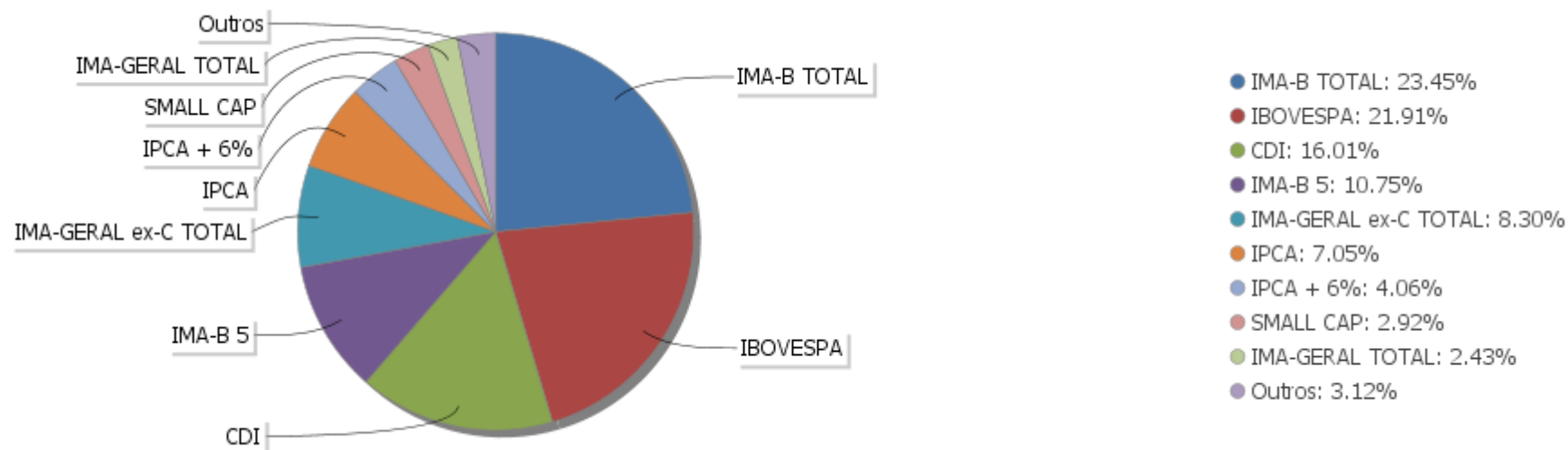
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	519.782.969,15	92,88	519.782.969,15	92,88
de 31 a 364 dias	24.726.776,16	4,42	544.509.745,31	97,30
acima de 365 dias	15.127.540,23	2,70	559.637.285,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

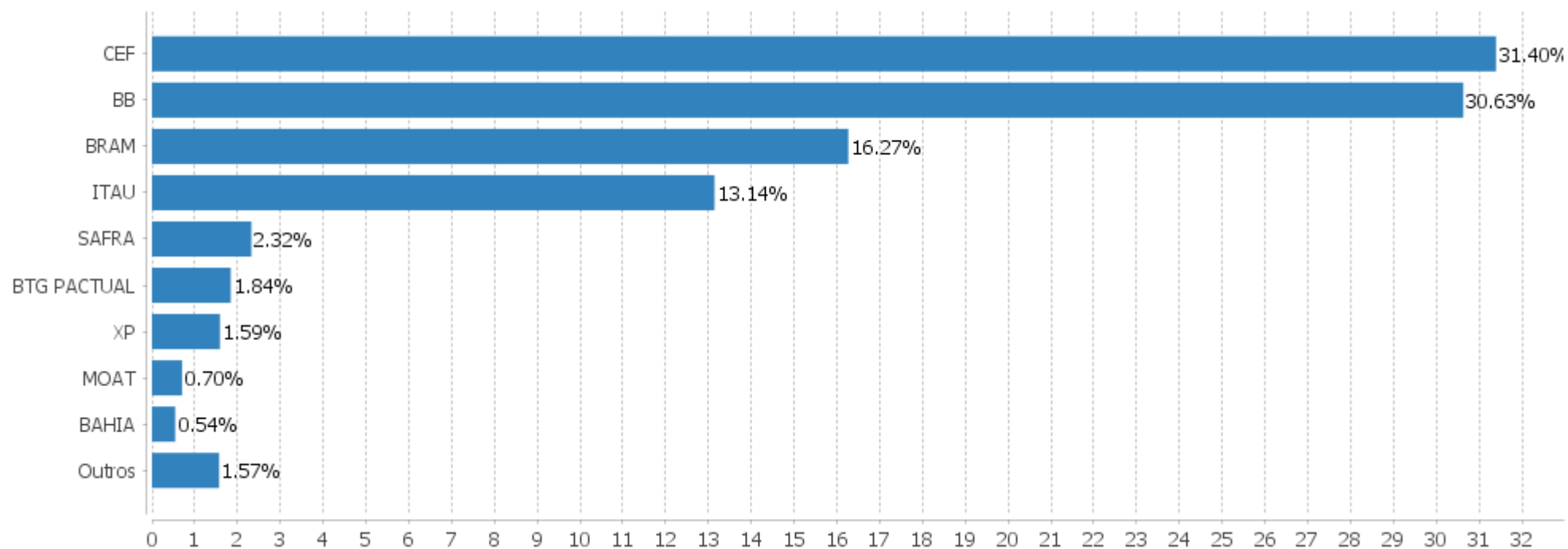


Alocação Por Estratégia



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	3,90						-0,51
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88						3,83
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02						-4,35
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

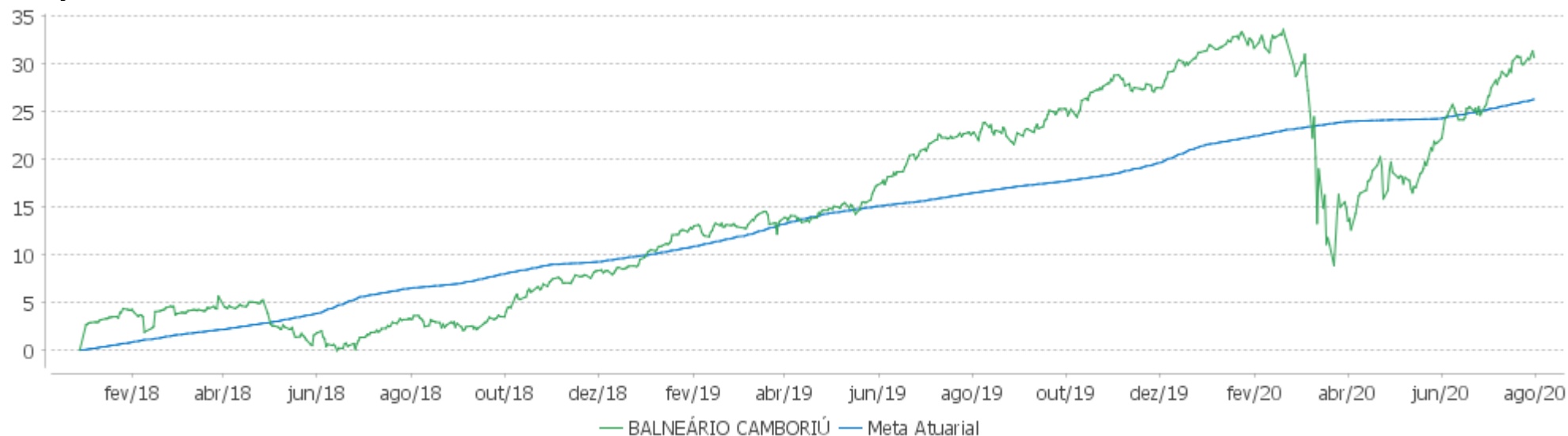
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

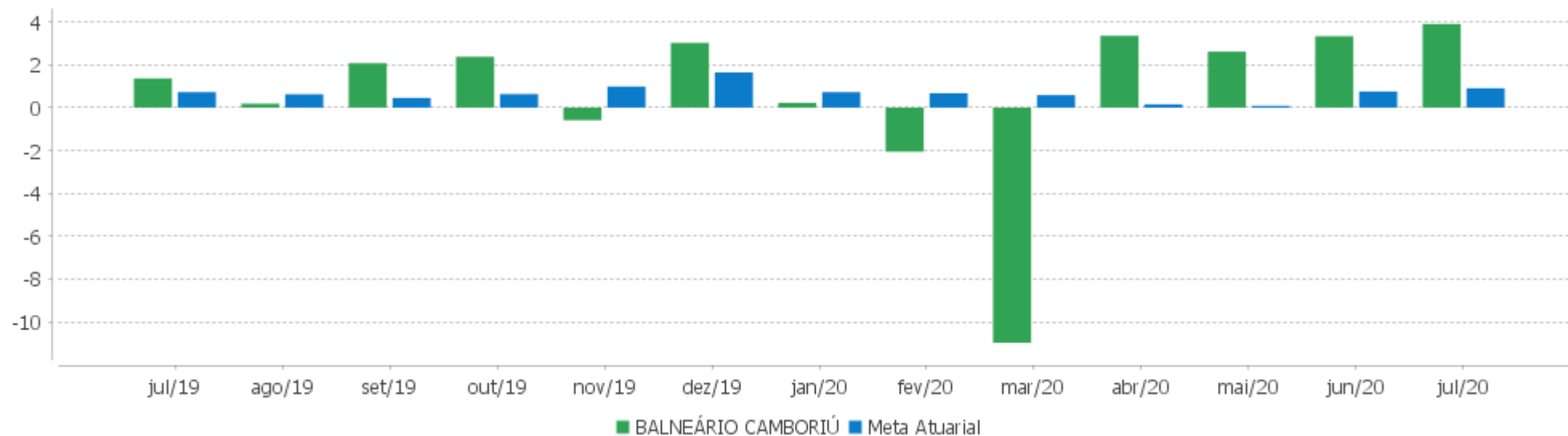
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	58,06	03 meses	10,16	1,70	8,46	7,84
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	41,94	06 meses	-0,73	3,10	-3,84	20,12
			12 meses	6,66	8,39	-1,74	14,47
			24 meses	26,49	18,54	7,95	10,69
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2018-01	Desde 29/12/2017	30,70	26,22	4,48	9,93
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
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 -3,27	4,69 2,04	4,84 -3,30	3,97 1,59	9,53 1,38	28,55 -9,31	38,72 -8,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,38 -0,01	2,42 -0,23	8,09 -0,05	2,17 -0,22	7,72 -0,43	37,07 -0,79	45,56 -1,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,05 -0,15	4,23 -0,05	3,48 -0,13	8,54 -0,29	23,61 -0,55	33,54 -0,89
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,11 -0,08	4,19 -0,10	3,55 -0,07	8,66 -0,17	23,54 -0,62	33,21 -1,22
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,08 -0,11	4,20 -0,08	3,51 -0,11	8,59 -0,24	23,64 -0,51	33,60 -0,83
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,15 -0,23	2,51 -0,14	7,72 -0,42	2,25 -0,13	7,90 -0,25	36,93 -0,94	45,32 -1,44
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,72 -0,25	3,25 -1,01	3,69 1,70	2,82 -0,72	7,54 -1,34	23,01 4,01	42,72 12,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,09 0,01	5,87 -0,13	3,29 -0,04	4,99 -0,08	9,54 -0,27	25,97 -0,62	35,83 -0,95
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,65 -0,09	3,29 -0,35	3,54 -0,25	2,79 -0,28	6,86 -0,47	22,77 -1,07	31,39 -1,72
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 -4,32	0,81 -1,84	1,77 -6,37	0,84 -1,54	4,20 -3,95	14,12 -23,74	20,80 -25,96
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,86 -0,03	4,45 0,54	1,39 -0,35	3,10 -0,07	8,50 0,03	18,92 0,29	28,10 -3,22
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,81 0,42	4,27 1,62	8,73 0,59	3,91 1,53	10,28 2,12		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,36 -0,02	2,50 -0,15	8,01 -0,13	2,26 -0,12	7,90 -0,26	36,89 -0,97	45,05 -1,70
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,32 -4,07	1,97 -0,68	2,58 -5,56	1,77 -0,61	5,74 -2,41	18,19 -19,68	27,84 -18,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,77 0,11	3,55 0,15	3,83 0,26	3,05 0,17	7,10 0,02	23,78 0,51	32,81 0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,98 0,62	5,65 5,19	3,14 2,90	4,79 4,54	9,68 7,38	28,24 22,64	37,15 26,81
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,87	4,49	1,40	3,13	8,57	19,09	28,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 6% p.p.	-0,11	0,23	-0,58	-0,41	-0,31	0,08	-2,34
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,36	2,54	8,07	2,27	7,94	37,20	45,69
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,11	-0,07	-0,11	-0,22	-0,66	-1,07
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,67	3,19	3,53	2,70	6,77	22,63	31,27
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,01	-0,20	-0,04	-0,18	-0,30	-0,64	-0,98
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,28	1,51	11,38	1,46	7,68	48,58	54,96
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,05	-0,16	-0,12	-0,18	-0,13	-0,79	-1,23
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	-1,15	-1,61	-0,58	-0,84	32,36	30,06	-23,91
% do CDI	-591,26	-82,43	-89,78	-53,68	767,77	277,61	-128,04
BRADERCO H FI RF NILO	4,62	3,26	8,88	2,88	8,89	40,64	51,94
% do CDI	2.378,09	167,08	1.379,68	183,29	210,89	375,34	278,10
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,43	4,08	8,21	3,87	9,85	41,29	49,85
% do CDI	2.281,81	209,02	1.275,07	246,39	233,81	381,33	266,90
BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	0,90	7,46	2,83	6,45	11,23	27,43	39,68
% do CDI	461,32	382,00	440,23	410,65	266,42	253,31	212,48
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,24	1,61	0,75	1,26	3,74	10,19	18,03
% do CDI	121,46	82,50	117,07	80,04	88,70	94,14	96,53
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,18	1,83	0,60	1,46	4,02	10,43	18,07
% do CDI	91,82	93,67	93,57	93,30	95,33	96,34	96,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,25	1,62	0,82	1,25	3,72	10,14	17,77
% do CDI	127,85	83,02	127,63	79,33	88,18	93,65	95,15
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	1,11	5,15	4,81	4,46	10,13	30,10	
Var. IPCA + 6% p.p.	0,22	1,24	3,08	1,29	1,66	11,48	
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	0,07	5,52	0,60	5,35	9,73	21,94	
% do CDI	35,62	282,57	92,63	340,81	230,79	202,65	
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	7,33	0,99	11,39	1,02	6,98	47,49	53,87
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,01	-0,69	-0,11	-0,62	-0,83	-1,88	-2,32
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	1,86	3,90	4,13	3,31	7,50	24,22	33,43
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,13	0,26	0,34	0,24	0,18	0,38	0,31
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,55	2,83	1,54	2,48	5,21	19,22	29,15
Var. IPCA p.p.	0,19	2,37	1,30	2,23	2,90	13,62	18,81
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	8,14	-11,05	27,43	-9,54	0,90	29,08	54,06
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-0,04	-0,41	-0,01	-0,18	-0,83	-2,06
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	8,22	-11,19	27,70	-9,69	0,80	29,49	54,98
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	-0,18	-0,13	-0,15	-0,28	-0,42	-1,14
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	-0,02	-2,10	-1,17	-1,52	13,75	141,08	168,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,92	-6,01	-2,90	-4,68	5,28	122,45	137,57
FIP CAIXA CYRELA Var. IBOVESPA p.p.	-26,67 -34,93	-31,73 -20,72	-24,37 -52,21	-34,89 -25,36	-42,78 -43,86	-36,86 -66,77	
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII Var. IFIX p.p.	0,75 3,36	-32,96 -18,44	2,90 -2,07	0,65 11,84	-40,25 -43,02	-48,68 -75,54	
FI IMOBILIÁRIO THE ONE Var. IFIX p.p.	-3,19 -0,59	-22,24 -7,72	2,50 -2,47	-13,76 -2,57	-0,83 -3,59	14,38 -12,48	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA Var. IFIX p.p.	-4,25 -1,64	-36,52 -22,00	3,56 -1,41	-18,19 -7,00	-0,00 -2,77	4,39 -22,47	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	5,58 -2,68	-0,63 10,38	12,06 -15,77	-0,99 8,54	8,83 7,75	19,17 -10,73	42,60 -13,52
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI Var. SMALL CAP p.p.	10,14 0,63	-17,47 -4,27	31,08 -0,58	-17,78 -4,19	0,93 -6,93	41,18 -14,09	51,52 -20,44
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,78 0,51	-6,42 4,59	26,25 -1,58	-4,21 5,32	10,38 9,30	49,87 19,96	106,14 50,03
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	10,05 1,78	-16,95 -5,94	29,32 1,49	-15,87 -6,33	-6,40 -7,48	22,01 -7,90	57,60 1,49
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,35 2,08	-8,92 2,09	29,17 1,33	-8,39 1,15	5,22 4,14	33,39 3,48	68,54 12,42
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	5,80 -2,47	-24,37 -13,36	29,49 1,65	-25,46 -15,92	-12,43 -13,51	22,51 -7,40	52,70 -3,42
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	6,94 3.569,23	-25,46 -1.304,43	27,45 4.263,65	-28,08 -1.789,21	-6,86 -162,67	54,79 506,00	37,38 200,16
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7,54	-16,38	23,81	-16,23	-0,92	38,66	71,08
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	8,32 1,79	-9,87 3,18	21,78 -0,08	-11,23 0,43	4,70 1,20	50,50 4,00	62,91 -0,28
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO Var. IBRX 100 p.p.	8,42 0,01	-8,97 1,46	27,73 -0,47	-8,85 0,44	4,28 2,11	37,48 3,79	71,45 12,41
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,38 0,11	-0,65 10,36	31,79 3,96	-2,63 6,91	12,75 11,67	62,07 32,16	87,26 31,14
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,15 0,63	-16,70 -3,65	20,14 -1,72	-14,37 -2,72	-8,25 -11,75	17,96 -28,53	40,02 -23,17
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	7,41 -0,21	-4,73 -0,63	26,85 -0,69	-7,85 -0,36	11,99 -0,17	50,68 -3,76	52,12 -5,91
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	12,54 4,28	84,50 33,89	42,57 14,74				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	9,27 1,01	-14,17 -3,16	29,24 1,41	-14,60 -5,06	6,10 5,02	47,15 17,25	63,31 7,19
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	8,46 0,20	-9,56 1,46	27,16 -0,67	-10,16 -0,63	4,36 3,28	37,47 7,56	60,62 4,50
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	6,77 -1,50	-17,03 -6,02	19,26 -8,57	-16,68 -7,15	-7,01 -8,09	24,01 -5,90	35,50 -20,61
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,23 -0,04	-8,64 2,37	24,69 -3,15	-10,09 -0,55	9,43 8,35	58,19 28,28	87,18 31,06
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	1,87 -6,40	51,21 62,22	12,06 -15,77	38,89 48,43	71,10 70,02		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	3,31 2,41	56,90 52,99	17,45 15,71	44,19 41,03			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,88 -6,39	35,34 46,35	9,28 -18,55	27,06 36,60	55,47 54,39	69,34 39,44	132,22 76,11
BALNEÁRIO CAMBORIÚ Var. IPCA + 6% p.p.	3,90 3,01	-0,51 -4,42	10,16 8,43	-0,73 -3,90	6,66 -1,81	26,49 7,86	
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
Renda Variável							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
303	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	270.154,17626000	3,7015900000
304	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	930.000,00	251.243,38361300	3,7015900000
308	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	195.000,00	52.680,06434000	3,7015900000
319	02/07/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	6.239,61542754	160,2662875000
296	03/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	60.131,03	0,00	16.240,02030900	3,7026450000
292	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	127.519,71	55.936,63814800	2,2797170910
305	06/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	91.867,70	24.809,22042500	3,7029660000
309	06/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.000,00	2.160,43028600	3,7029660000
295	09/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.644,54	0,00	20.894,71718200	2,2802194250
310	09/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	15.500,00	4.185,07537300	3,7036370000
297	10/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.414.026,39	0,00	381.745,45396600	3,7041080000
298	13/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.000.000,00	0,00	1.349.742,96844600	3,7044090000
306	13/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	269.948,59273900	3,7044090000
314	13/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.000.000,00	0,00	343.797,26137900	2,9086910000
315	13/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	1.718.986,30735500	2,9086910000
317	14/07/2020	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,00	3.000.000,00	692.239,21387460	4,3337620000
318	14/07/2020	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	3.000.000,00	0,00	1.802.117,84889600	1,6647080000
290	16/07/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5.000.000,00	0,00	251.835,98582600	19,8541919400
291	16/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.000.000,00	0,00	2.629.967,22155600	2,2813972550
293	16/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	21.000.000,00	14.096.290,28351400	1,4897536570
316	16/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.000.000,00	0,00	3.359.837,97517300	1,4881670000
320	16/07/2020	BRABESCO H FI RF NILO	5.000.000,00	0,00	2.236.648,70578112	2,2354874000
294	17/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.190,94	0,00	26.818,05565300	2,2817068020
299	17/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	360.000,00	0,00	97.132,48709300	3,7062780000
300	17/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.372.788,65	0,00	1.179.832,88085700	3,7062780000
301	21/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.020.000,00	0,00	275.167,35975500	3,7068350000
311	21/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	257.792,59	69.545,20224600	3,7068350000
312	22/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.200,00	323,69930400	3,7071440000

Carteira: BALNEÁRIO CAMBORIÚ

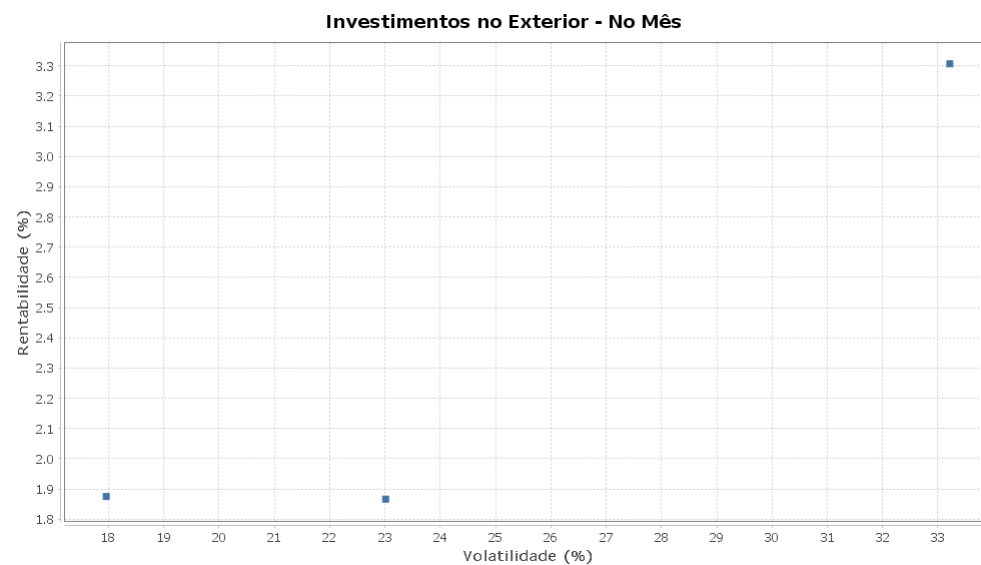
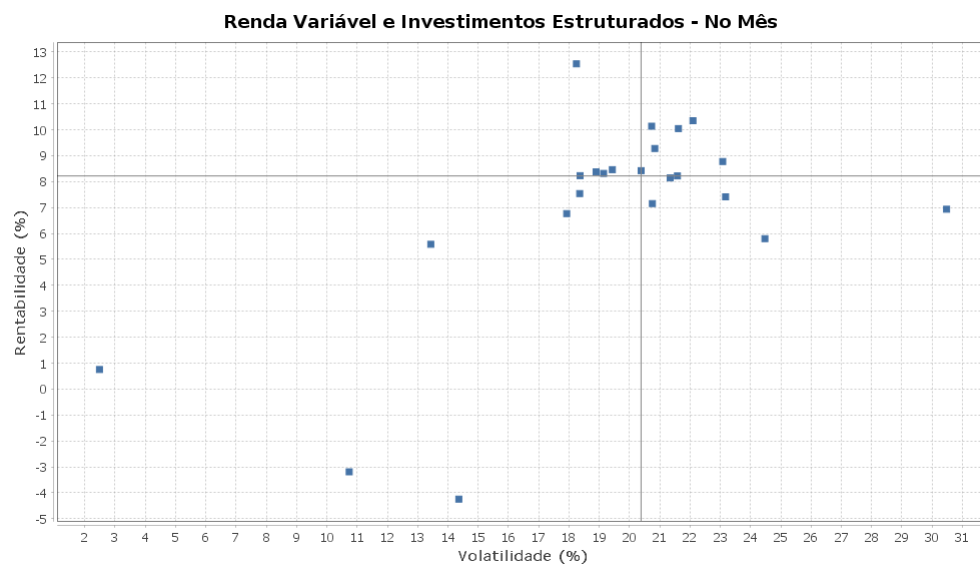
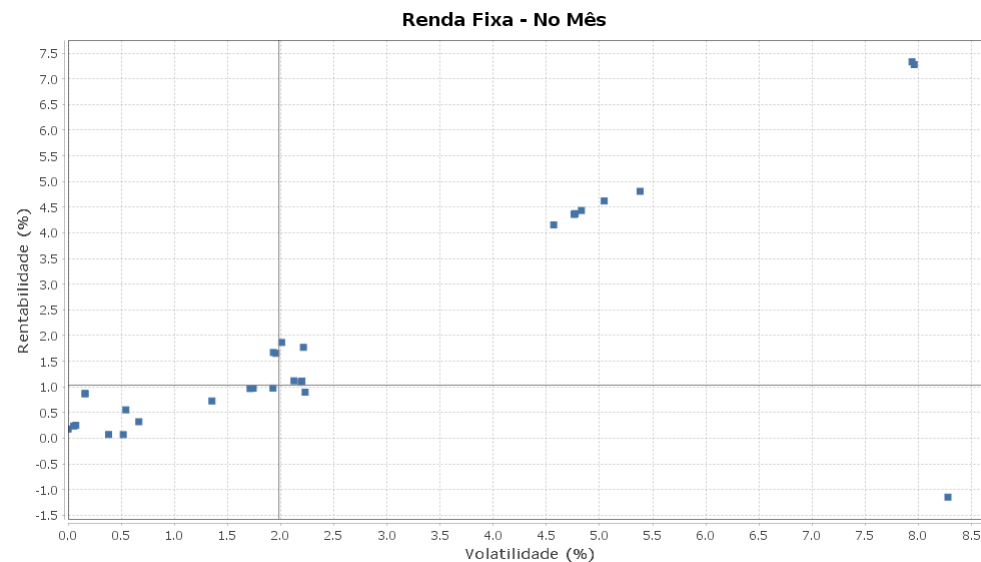
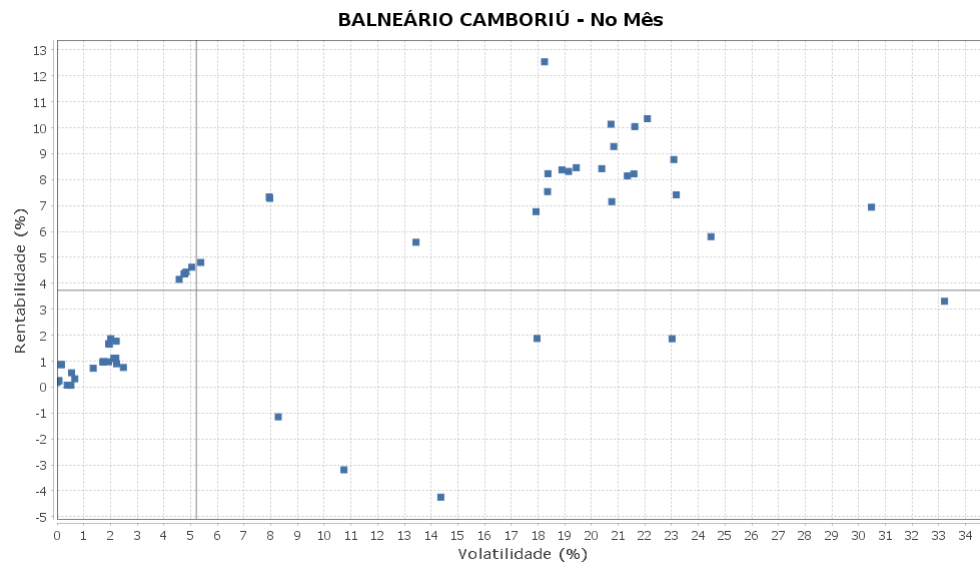
Data Extrato: 31/07/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
307	29/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.489.033,70	940.661,69823900	3,7091270000
313	30/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	37.937,90	10.226,67593700	3,7097000000
302	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	97.725,00	0,00	26.338,16615200	3,7103950000
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	0,00	0,02	-0,00	-15,87	0,18	3.803.071,52	0,68
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,10	-0,00	0,78	0,24	10.541.589,18	1,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,74	0,25	9.001.923,91	1,61
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,16	0,10	-0,00	4,22	0,87	2.873.246,00	0,51
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,16	0,10	-0,00	4,17	0,86	5.766.632,00	1,03
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,38	0,59	0,00	-0,32	0,07	3.217.883,57	0,57
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,52	0,69	-0,01	-0,24	0,07	11.088.701,99	1,98
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,53	0,01	0,66	0,55	25.186.808,36	4,50
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,67	1,02	0,00	0,19	0,32	791.806,83	0,14
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	1,86	0,00	0,39	0,72	1.357.466,57	0,24
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	2,11	0,09	0,45	0,97	29.145.048,85	5,21
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	2,27	0,01	0,45	0,97	3.046.358,82	0,54
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	2,27	0,08	0,45	0,97	25.877.398,59	4,62
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,93	2,83	0,05	0,41	0,98	12.912.763,74	2,31
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,93	2,65	0,02	0,76	1,67	4.504.827,55	0,80
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	2,68	0,04	0,74	1,65	9.727.424,47	1,74
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,01	2,93	0,02	0,83	1,86	3.448.848,05	0,62
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	2,68	0,01	0,43	1,12	3.262.853,03	0,58
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	2,84	0,00	0,41	1,09	46.583,95	0,01
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	2,20	3,74	0,03	0,42	1,11	6.472.794,94	1,16
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	3,09	0,19	0,71	1,77	40.331.402,54	7,21
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,23	3,03	0,04	0,31	0,90	10.160.073,76	1,82
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,48	0,89	0,00	0,22	0,75	89.349,14	0,02
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,57	5,64	0,02	0,87	4,15	2.462.842,76	0,44
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,76	5,90	0,03	0,88	4,36	3.382.475,03	0,60
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,76	5,98	0,42	0,87	4,36	44.956.797,09	8,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	5,93	0,63	0,88	4,38	67.468.208,81	12,06
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,83	6,68	0,13	0,88	4,43	12.941.844,20	2,31
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,04	6,94	0,27	0,88	4,62	24.906.429,90	4,45
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	6,81	0,01	0,86	4,81	1.185.107,47	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,94	9,22	0,03	0,90	7,33	2.332.731,74	0,42
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,96	9,30	0,06	0,89	7,28	3.934.894,82	0,70
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	8,28	0,04	0,00	-0,16	-1,15	1.951.801,07	0,35
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	10,74	0,55	0,00	-0,32	-3,19	1.110.968,00	0,20
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	13,43	19,87	0,33	0,40	5,58	11.718.821,43	2,09
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	14,36	0,68	0,00	-0,31	-4,25	590.815,80	0,11
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	17,92	27,75	0,46	0,37	6,77	9.476.848,85	1,69
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	17,96	15,75	0,12	0,09	1,88	8.574.013,83	1,53
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,25	23,88	0,15	0,68	12,54	3.900.480,79	0,70
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	18,35	30,76	0,48	0,40	7,54	8.873.403,00	1,59
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,37	24,93	0,87	0,44	8,23	20.185.910,43	3,61
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,89	29,94	0,40	0,43	8,38	7.768.030,64	1,39
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,14	26,52	0,10	0,42	8,32	2.140.960,83	0,38
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	19,43	27,69	0,16	0,43	8,46	3.303.309,28	0,59
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	20,38	24,84	0,08	0,40	8,42	1.780.904,66	0,32
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	20,73	26,36	0,72	0,48	10,14	15.763.748,76	2,82
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,76	24,57	0,35	0,34	7,15	8.224.276,41	1,47
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	20,83	27,37	0,53	0,44	9,27	11.104.292,92	1,98
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,34	26,19	0,56	0,37	8,14	12.213.575,64	2,18
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	21,58	26,51	0,31	0,37	8,22	6.757.691,50	1,21
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	21,62	25,69	0,40	0,46	10,05	8.976.674,68	1,60
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,09	27,09	0,14	0,46	10,35	3.013.465,92	0,54
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	23,01	20,55	0,03	0,07	1,87	2.004.925,29	0,36
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,08	32,37	0,17	0,37	8,78	2.930.915,77	0,52
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	23,17	29,93	0,14	0,31	7,41	2.712.176,80	0,48
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,47	32,60	0,31	0,23	5,80	5.346.203,33	0,96
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	30,48	35,52	0,12	0,22	6,94	2.120.196,23	0,38
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	33,21	18,33	0,03	0,09	3,31	8.869.703,77	1,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 6,48% 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;