



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
SETEMBRO 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

69,01%

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	12,25	-1,47	-0,84	2.382.528,83	0,43	210.474.693,71	1,13
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	4,98	-0,15	4,38	3.054.177,86	0,56	1.382.335.404,22	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,68	-1,55	-0,91	3.269.853,26	0,60	361.495.639,46	0,90
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,72	-1,56	-0,93	43.437.136,99	7,92	5.533.318.681,28	0,79
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,79	-1,53	-1,00	65.217.711,28	11,90	5.834.527.804,73	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,49	-0,61	1,92	9.598.332,11	1,75	1.241.251.655,53	0,77
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	4,29	25.937.404,65	4,73	17.747.142.317,32	0,15
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,64	-2,65	-5,40	4.174.717,83	0,76	1.936.096.946,75	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,37	-0,79	1,64	4.436.959,18	0,81	533.696.783,92	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	-0,61	4,41	45.941,96	0,01	11.234.342.142,99	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,98	-0,15	4,30	49.176.856,95	8,97	4.406.252.863,92	1,12
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,12	-0,14	5,03	3.194.341,87	0,58	286.045.614,65	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,35	0,19	2,64	275.836,30	0,05	238.949.489,36	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	1,86	19.666.635,75	3,59	10.452.752.168,75	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	12.776.209,56	2,33	13.535.810.678,86	0,09
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,59	-2,09	0,03	1.136.818,31	0,21	1.656.081.726,62	0,07
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,15	-0,10	3,58	859.913,36	0,16	570.142.358,76	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,89	6,19	5.704.152,00	1,04	191.834.401,47	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,38	0,89	6,24	2.840.314,00	0,52	217.257.318,07	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,42	-0,90	1,36	257.185.842,05	46,91		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,10	-0,03	1,95	2.508.398,48	0,46	7.401.970.907,24	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,52	-1,67	0,38	12.482.142,95	2,28	634.471.413,86	1,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	-0,00	1,28	10.416.809,39	1,90	4.760.770.417,77	0,22
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,94	-0,51	2,72	3.409.982,86	0,62	782.744.149,23	0,44
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,02	1,82	8.909.972,05	1,63	2.533.726.732,47	0,35
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,85	-2,59	9,37	2.678.045,63	0,49	240.348.297,77	1,11
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,40	-1,61	-0,49	24.002.258,66	4,38	849.965.819,26	2,82
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	-0,23	2,47	25.097.727,28	4,58	4.773.930.449,92	0,53
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,61	-0,55	6,45	10.064.625,46	1,84	978.923.853,75	1,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,07	0,04	5,97	11.136.414,19	2,03	756.238.253,96	1,47
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,09	-0,31	5,51	6.494.968,64	1,18	84.401.358,94	7,70
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1,34	-0,03	-0,03	1.999.389,66	0,36	525.408.418,27	0,38
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,78	-0,70	2,32	119.200.735,25	21,74		

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	28,99	-0,23	-1,97	1.944.621,74	0,35	109.874.853,64	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			28,99	-0,23	-1,97	1.944.621,74	0,35		
Renda Fixa			7,66	-0,84	1,59	378.331.199,04	69,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,32%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS	44,29	-4,81	-18,28	6.690.577,05	1,22	339.715.925,19	1,97
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,83	-4,71	-18,15	11.711.151,48	2,14	634.870.630,59	1,84
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,97	-4,74	-18,22	18.401.728,53	3,36		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRDESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	43,38	-4,32	-16,34	1.653.836,96	0,30	14.203.705,39	11,64
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	43,47	-2,74	-20,15	8.728.814,58	1,59	689.497.036,46	1,27
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	47,08	-5,17	-22,87	14.964.934,10	2,73	476.347.162,59	3,14
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,48	-4,70	-23,62	8.957.252,92	1,63	890.322.162,57	1,01
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	41,07	-5,04	-24,99	7.500.347,12	1,37	1.590.150.680,83	0,47
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,55	-5,04	-14,61	18.961.436,64	3,46	1.999.773.052,56	0,95
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,91	-4,26	-16,02	4.000.793,38	0,73	799.315.189,79	0,50
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	60,10	-8,11	-41,30	2.060.660,77	0,38	472.017.380,08	0,44
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,49	-2,97	-4,02	7.600.875,99	1,39	2.439.151.651,37	0,31
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,35	-4,45	-15,69	2.886.359,81	0,53	844.202.491,55	0,34
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	44,07	-7,12	-15,58	2.643.850,59	0,48	986.923.185,89	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,71	-4,06	-16,29	3.029.068,41	0,55	718.937.900,79	0,42
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,13	-4,93	-17,58	2.052.425,35	0,37	783.577.685,83	0,26
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,79	-5,93	-20,37	10.395.452,55	1,90	1.156.431.775,09	0,90
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,48	-4,96	-20,69	8.416.636,86	1,54	3.159.975.144,49	0,27
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	51,80	-8,03	-33,17	4.723.745,54	0,86	1.558.252.031,74	0,30
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	42,38	-7,67	64,09	3.561.349,51	0,65	1.040.770.340,32	0,34
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,06	-5,04	-19,64	112.137.841,08	20,45		

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	32,00	-4,80	1,10	9.936.311,66	1,81	545.147.723,89	1,82
Sub-total Artigo 8º III			32,00	-4,80	1,10	9.936.311,66	1,81		

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	66,02	0,12	-1,97	848.297,09	0,15	14.745.453,20	5,75
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	88,56	-0,23	-31,99	1.145.497,05	0,21	61.323.689,95	1,87
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			63,99	-0,08	-19,42	1.993.794,14	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	26,91	-0,03	-20,21	1.140.076,00	0,21	140.712.001,53	0,81
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	51,72	0,11	-34,45	610.050,06	0,11	588.319.069,28	0,10
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,73	1,81	-31,65	90.801,94	0,02	15.335.692,09	0,59
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			38,86	0,10	-26,15	1.840.928,00	0,34		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,66	-4,91	-17,91	144.310.603,41	26,32		
----------------------------------------------------	--	--	--------------	--------------	---------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,67%

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	28,08	-1,63	49,79	3.225.645,78	0,59	135.356.433,49	2,38
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,45	3,00	67,87	12.703.969,46	2,32	830.681.972,32	1,53
Sub-total Artigo 9º A, II			30,49	2,05	63,73	15.929.615,24	2,91		

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	28,45	-1,99	52,76	9.677.155,09	1,77	1.671.279.124,17	0,58
Sub-total Artigo 9º A, III			28,45	-1,99	52,76	9.677.155,09	1,77		
Investimentos no Exterior			25,91	0,44	62,47	25.606.770,33	4,67		
Total			14,67	-1,89	-2,86	548.248.572,78	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	257.185.842,05	46,91	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	119.200.735,25	21,74	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.944.621,74	0,35	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	378.331.199,04	69,01				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	18.401.728,53	3,36	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	112.137.841,08	20,45	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	9.936.311,66	1,81	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.993.794,14	0,36	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.840.928,00	0,34	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	144.310.603,41	26,32				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	15.929.615,24	2,91	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.677.155,09	1,77	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.606.770,33	4,67				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

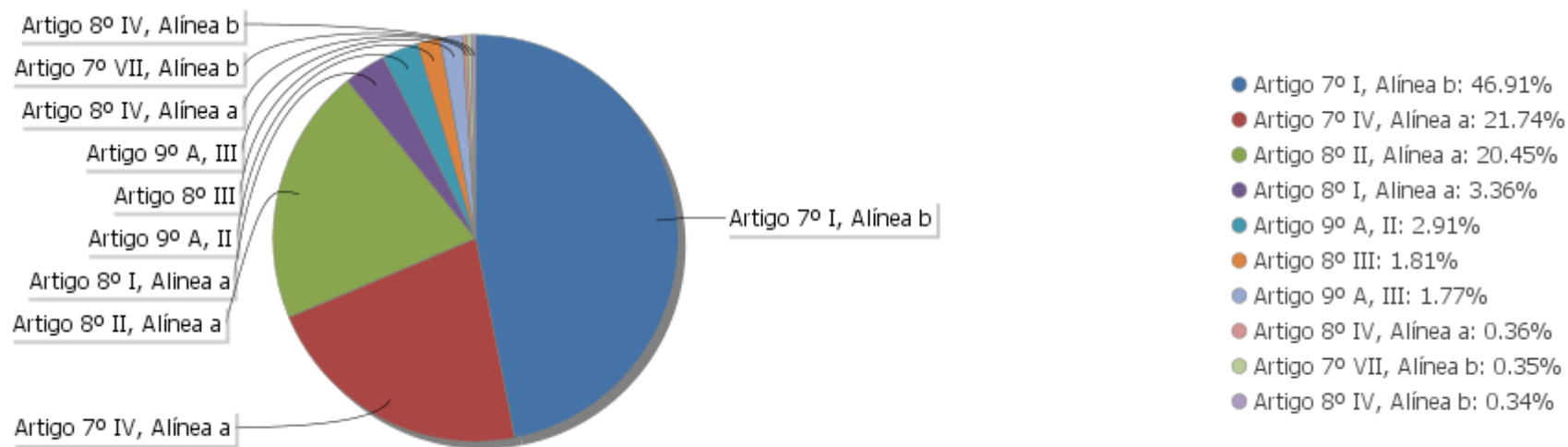
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,90 -575,45	1,36 59,67	0,78 151,64	4,68 373,97	3,65 103,14	-2.442.012,71	3.806.044,76
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,70 -446,68	2,32 102,12	0,55 107,12	3,52 281,67	4,26 120,13	-817.429,81	2.505.752,88
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,23 -146,48	-1,97 -86,62	-1,51 -295,40	-0,93 -74,51	30,19 852,15	-4.481,60	-39.794,35
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,74 0,05	-18,22 -0,03	-0,51 -0,04	29,21 -0,35	-9,75 -0,07	-916.150,88	-3.071.954,61
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,04 -0,24	-19,64 -1,45	0,81 1,29	31,26 1,70	-9,09 0,60	-5.993.142,29	-25.005.158,19
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,80 0,00	1,10 19,29	7,41 7,89	27,36 -2,20	9,96 19,64	-586.302,43	385.518,65
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 4,72	-19,42 -1,22	-14,65 -14,18	-24,68 -54,24	-15,84 -6,16	-1.539,10	-196.072,45
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,10 4,90	-26,15 -7,95	-0,65 -0,17	9,20 -20,36	-1,28 8,41	1.919,91	-652.279,06
Artigo 9º A, II % do CDI	2,05 1.307,23	63,73 4.084,26	20,91 4.083,80	60,81 4.862,21		301.634,78	4.429.615,24
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,99 -1.270,48	52,76 2.318,55	14,98 2.925,84	43,04 3.441,04	61,21 1.727,74	-196.917,13	3.033.285,09
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						-10.654.421,26	-14.805.042,04

Análise de Liquidez

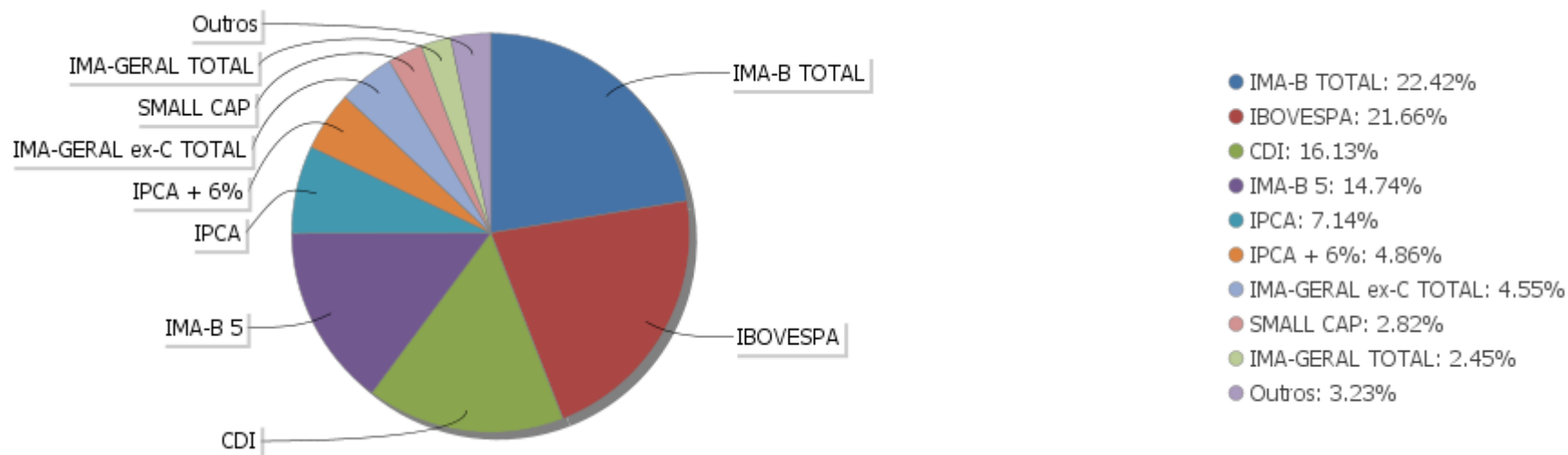
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	510.675.764,77	93,15	510.675.764,77	93,15
de 31 a 364 dias	23.600.148,60	4,30	534.275.913,37	97,45
acima de 365 dias	13.972.659,41	2,55	548.248.572,78	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

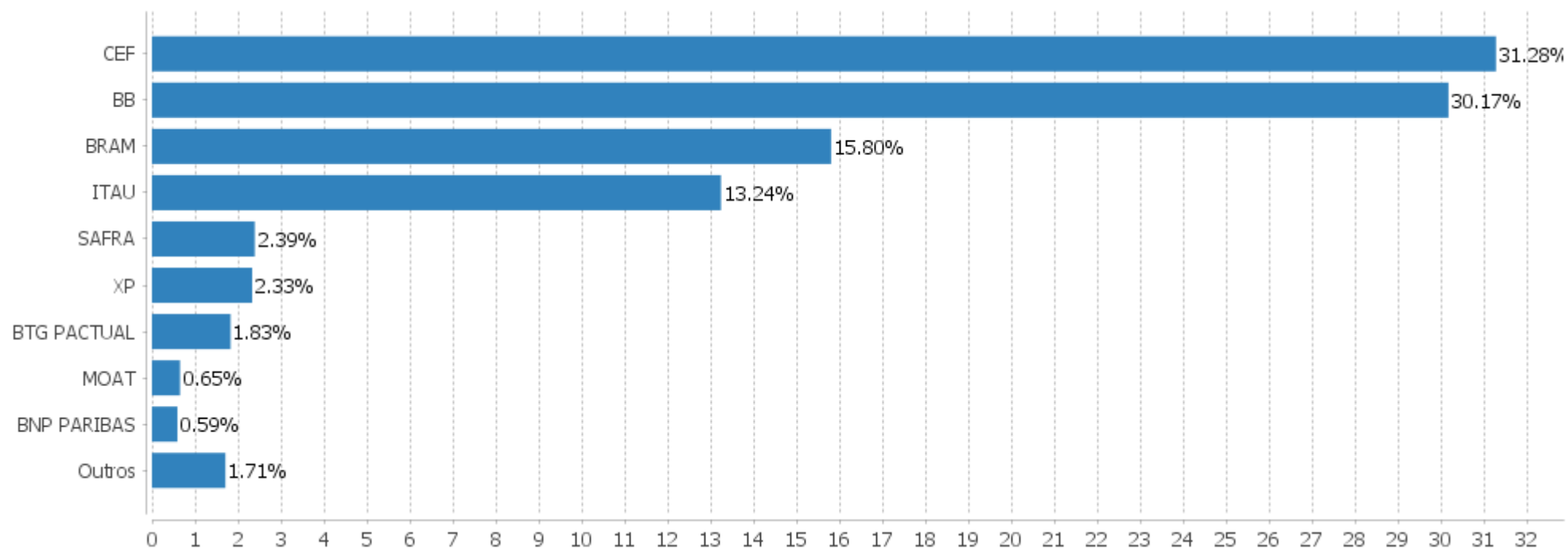


Alocação Por Estratégia



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	-0,48	-1,89				-2,86
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12				5,75
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02	-1,20	-3,01				-8,61
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

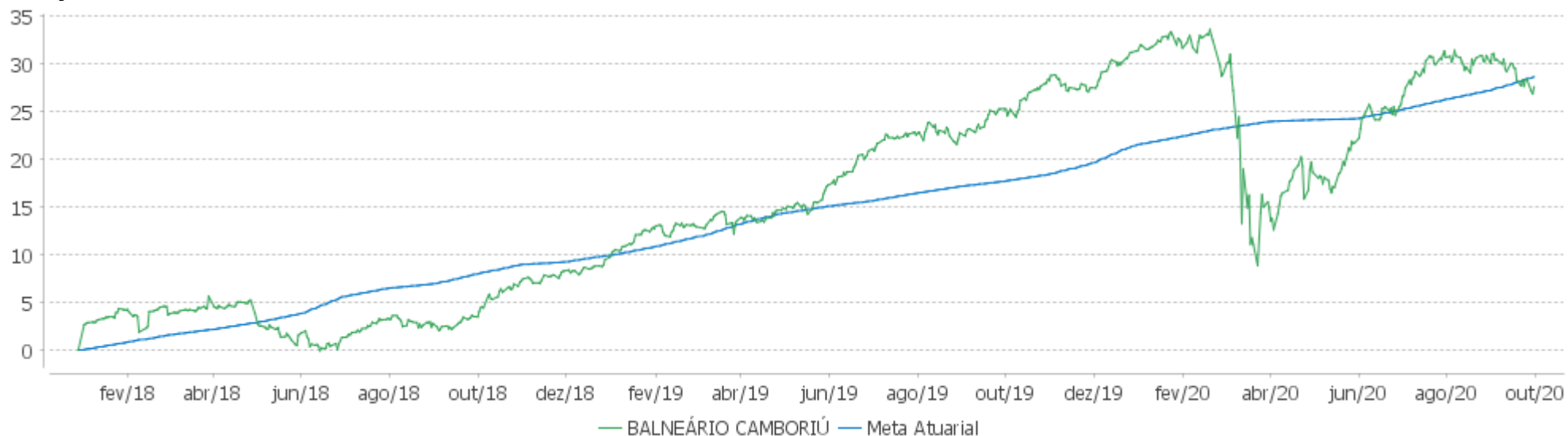
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

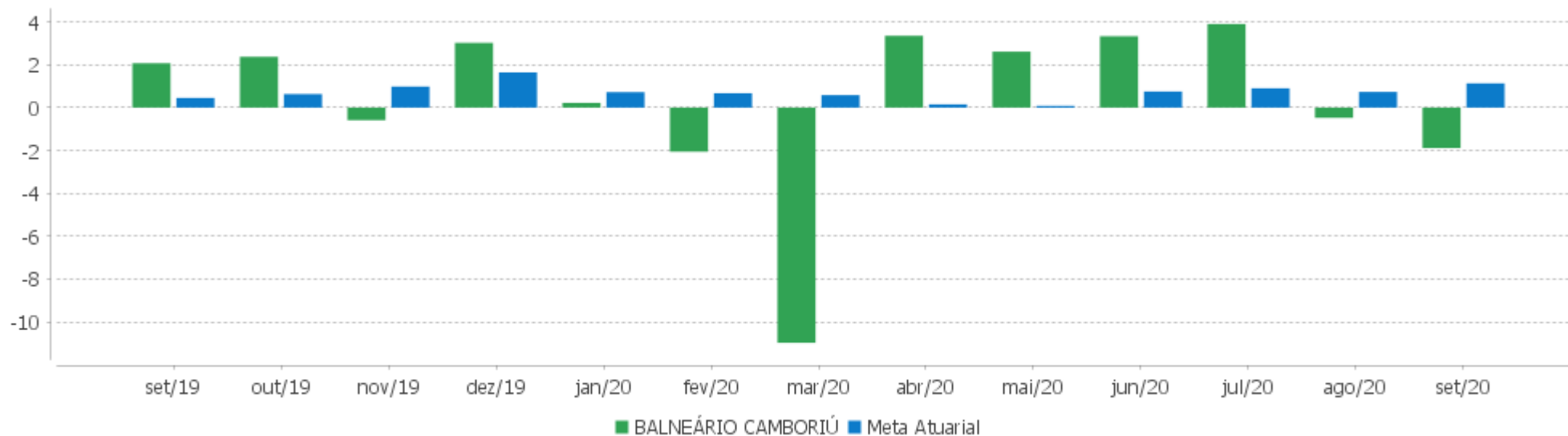
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	54,55	03 meses	1,45	2,75	-1,30	7,39
Meses abaixo da Meta Atuarial	15	45,45	06 meses	11,16	3,73	7,44	9,81
			12 meses	1,83	9,22	-7,39	14,67
			24 meses	23,27	19,10	4,17	10,85
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2018-01	Desde 29/12/2017	27,61	28,55	-0,94	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 FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-0,23 -146,48	-1,97 -86,62	-1,51 -295,40	-0,93 -74,51	30,19 852,15	29,91 297,97	-23,65 -136,24
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	-1,61 -1.027,68	-0,49 -21,41	0,82 160,82	6,66 532,49	2,35 66,21	36,71 365,69	40,39 232,69
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,67 -1.062,65	0,38 16,84	0,72 141,56	5,96 476,77	3,18 89,80	37,20 370,61	40,10 231,03
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,02 15,30	1,82 79,94	0,44 86,28	1,22 97,65	2,98 84,04	9,27 92,40	16,58 95,53
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,55 -350,62	6,45 283,36	-0,05 -10,02	3,09 246,86	8,31 234,56	25,84 257,45	34,86 200,84
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	-0,03 -17,94	1,95 85,62	0,30 57,86	0,99 78,79	3,17 89,43	9,45 94,18	16,54 95,30
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF % do CDI	-0,01 -8,22	2,52 110,54	0,49 95,11	1,63 129,96	3,85 108,76		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	-0,00 -1,68	1,77 77,58	0,39 76,38	0,97 77,46	2,90 81,81	9,20 91,67	16,28 93,76
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6% p.p.	-0,31 -1,44	5,51 -0,34	1,46 -1,32	6,03 2,24	8,31 -1,01	30,63 11,43	
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI	0,04 27,56	5,97 262,37	0,50 97,60	1,66 132,37	8,62 243,38	21,95 218,71	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,59 0,01	-5,30 -0,75	0,65 -0,10	6,52 -0,26	-2,47 -0,79	40,56 -1,86	39,11 -2,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,23 -0,87	2,47 1,12	0,20 -1,05	1,32 0,51	3,69 0,56	17,87 11,75	25,30 14,38
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,51 0,08	2,72 0,32	0,72 0,19	3,82 0,39	4,70 0,35	22,49 0,64	28,74 0,32
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14 1,38	5,03 5,75	1,45 0,49	5,75 -0,22	7,75 5,64	29,23 -4,91	35,28 -2,28
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-1,00 -0,28	0,89 -0,07	5,84 -0,12	1,68 -0,43	33,36 -0,78	36,41 -1,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	4,29 -0,22	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	-0,15	4,38	1,23	4,96	7,06	23,16	30,68

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.	-0,03	-0,13	-0,06	-0,15	-0,18	-0,59	-1,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	-0,15	4,30	1,18	4,93	6,95	23,16	30,94
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,03	-0,20	-0,11	-0,17	-0,29	-0,59	-0,89
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	-1,47	-0,84	0,76	5,54	1,91	33,34	36,30
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04	-0,12	-0,20	-0,43	-0,20	-0,80	-1,26
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,61	1,92	0,30	3,01	3,80	20,81	26,70
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,01	-0,49	-0,22	-0,42	-0,55	-1,04	-1,72
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	-0,10	3,58	1,05	4,36	6,19	22,78	41,08
Var. INPC + 6% p.p.	-1,47	-2,99	-2,17	-0,13	-3,93	2,67	8,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,61	4,41	-0,30	3,01	6,31	24,12	30,74
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,05	-0,20	-0,07	-0,13	-0,25	-0,38	-0,90
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89	6,19	2,54	3,47	8,97	19,38	32,08
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,24	0,34	-0,24	-0,32	-0,35	0,17	0,09
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	-2,09	0,03	0,54	6,14	3,22		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,58	0,74	-0,42	0,17	1,12		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	-1,55	-0,91	0,89	5,77	1,86	33,23	36,01
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,19	-0,07	-0,19	-0,25	-0,91	-1,55
BB PREV RF VII	0,19	2,64	0,98	3,41	5,12	17,74	26,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,70	3,36	0,02	-2,56	3,01	-16,40	-11,25
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,75	1,86	0,10	3,07	3,70	21,50	27,56
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,04	-0,10	-0,15	0,08	-0,19	0,39	0,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	-0,50	4,53	-0,09	3,18	6,41	25,88	33,17
Var. IPCA p.p.	-1,14	3,19	-1,34	2,37	3,27	19,76	22,25
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,89	6,24	2,56	3,50	9,05	19,54	32,37
Var. INPC + 6% p.p.	-0,47	-0,33	-0,66	-0,99	-1,07	-0,57	0,08
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,56	-0,93	0,83	5,77	1,83	33,39	36,49
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,21	-0,13	-0,20	-0,28	-0,75	-1,07
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,79	1,64	0,14	2,79	3,52	20,43	26,35
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,08	-0,32	-0,11	-0,21	-0,37	-0,68	-1,03
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-2,65	-4,82	0,59	6,44	-1,87	41,55	40,12
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,05	-0,26	-0,16	-0,34	-0,19	-0,87	-1,14
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	1,81	-31,65	2,73	1,43	-39,37	-47,68	
Var. IFIX p.p.	1,35	-19,05	3,14	-10,63	-43,49	-78,60	
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	-0,03	-20,21	-0,66	5,64	1,87	24,49	
Var. IFIX p.p.	-0,49	-7,61	-0,25	-6,42	-2,25	-6,43	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	0,11	-34,45	-1,13	17,99	2,61	24,63	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IFIX p.p.	-0,35	-21,86	-0,72	5,93	-1,51	-6,29	
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-4,71	-18,15	-0,49	29,15	-9,67	18,59	26,05
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	0,05	-0,01	-0,41	0,01	-0,64	-1,29
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-4,81	-18,40	-0,56	29,33	-9,91	18,74	26,56
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	-0,20	-0,08	-0,23	-0,23	-0,49	-0,78
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	0,12	-1,97	0,11	0,79	14,15	133,73	172,10
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,01	-7,82	-2,67	-3,00	4,82	114,52	140,11
FIP CAIXA CYRELA	-0,23	-31,99	-26,94	-38,43	-32,02	-36,98	
Var. IBOVESPA p.p.	4,57	-13,79	-26,47	-67,98	-22,34	-56,21	
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	-5,17	-22,87	2,92	34,65	-7,77	39,75	27,84
Var. SMALL CAP p.p.	0,27	-3,94	0,65	-0,85	-5,99	-14,74	-14,84
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-7,12	-15,58	-1,88	27,80	-4,83	40,45	63,23
Var. IBOVESPA p.p.	-2,33	2,61	-1,40	-1,76	4,85	21,22	35,90
BRADESCO FIA SELECTION	-2,74	-20,15	5,81	32,85	-12,72	15,23	31,92
Var. IBOVESPA p.p.	2,06	-1,95	6,28	3,29	-3,04	-4,00	4,58
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-4,45	-15,69	2,15	31,96	-5,14	23,13	36,96
Var. IBOVESPA p.p.	0,35	2,51	2,63	2,40	4,54	3,89	9,62
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-8,03	-33,17	-6,52	24,90	-23,46	13,87	19,15
Var. IBOVESPA p.p.	-3,24	-14,98	-6,04	-4,66	-13,78	-5,36	-8,18
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-8,11	-36,98	-9,58	15,62	-21,21	39,66	9,57
% do CDI	-5.163,62	-1.625,12	-1.871,47	1.249,23	-598,63	395,07	55,13
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-4,96	-20,69	2,00	30,39	-10,53	31,29	43,75
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,93	-17,58	-0,96	19,42	-6,98	43,54	33,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,30	3,49	2,35	4,64	2,83	5,70	3,42
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	-4,32	-15,46	0,69	32,21	-6,15	27,45	39,95
Var. IBRX 100 p.p.	0,26	1,96	0,73	1,87	2,44	4,20	9,48
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-2,97	-4,02	4,71	48,34	5,55	60,69	61,87
Var. IBOVESPA p.p.	1,83	14,18	5,18	18,78	15,24	41,45	34,53
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	-5,04	-24,99	-3,51	16,03	-18,40	5,58	14,82
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,41	-3,91	-0,21	1,25	-8,60	-32,26	-15,68
FIA CAIXA CONSUMO	-4,06	-10,05	1,41	40,64	-1,18	50,69	22,40
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,10	-0,79	-0,42	-1,37	-0,14	-2,34	-5,50
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-7,67	64,09	0,09	54,10			
Var. IBOVESPA p.p.	-2,87	25,64	0,57	24,54			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-5,93	-20,37	1,37	33,48	-4,18	45,25	33,42
Var. IBOVESPA p.p.	-1,13	-2,18	1,85	3,92	5,51	26,01	6,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-4,26 0,53	-16,02 2,17	0,71 1,18	31,74 2,18	-5,26 4,42	30,94 11,70	33,21 5,88
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-4,70 0,10	-23,62 -5,43	-1,71 -1,24	18,99 -10,57	-16,46 -6,77	13,75 -5,49	13,73 -13,61
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-5,04 -0,24	-14,61 3,59	1,16 1,63	33,49 3,94	-1,67 8,01	48,47 29,23	60,05 32,71
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-4,80 0,00	1,10 19,29	7,41 7,89	27,36 -2,20	9,96 19,64	16,39 -2,84	40,48 13,14
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	-1,63 3,17	69,46 87,65	14,16 14,63	48,30 18,74	82,99 92,67	83,28 64,04	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	3,00 1,87	86,27 80,42	22,64 19,86	64,22 60,43			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-1,99 2,80	52,76 70,95	14,98 15,46	43,04 13,48	61,21 70,90	70,33 51,09	154,87 127,53
BALNEÁRIO CAMBORIÚ Var. IPCA + 6% p.p.	-1,89 -3,02	-2,86 -8,71	1,45 -1,33	11,16 7,37	1,83 -7,49	23,27 4,06	
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA-C TOTAL	2,95	17,78	9,60	18,32	19,95	48,39	67,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	1,96	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14
SELIC	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
364	01/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000.000,00	873.951,14272100	2,2884574460
381	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	199.330,23	53.637,91262033	3,7162190000
392	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	269.090,70751751	3,7162190000
393	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	800.000,00	215.272,56601401	3,7162190000
394	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	112.867,28	30.371,53623078	3,7162190000
395	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	311.725,97	83.882,56181888	3,7162190000
379	02/09/2020	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	300.000,00	0,00	183.560,33628254	1,6343400000
380	02/09/2020	FIA CAIXA CONSUMO	500.000,00	0,00	244.190,82242981	2,0475790000
382	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	9.037,38	2.431,73036562	3,7164400000
383	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.120,00	839,51308241	3,7164400000
396	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	129.847,96	34.938,80164889	3,7164400000
414	02/09/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	5.316,09674447	188,1079386000
415	02/09/2020	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	1.000.000,00	0,00	349.372,07357217	2,8622780000
416	02/09/2020	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	1.129,52115444	885,3309175000
365	03/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20,90	9,13106700	2,2888891870
397	03/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	527.243,94	141.853,65646295	3,7168160000
398	04/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	111.427,99	29.976,00101150	3,7172400000
384	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	13.000,00	3.497,12899160	3,7173350000
399	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	227.143,35	0,00	61.103,81496421	3,7173350000
367	09/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.644,54	0,00	20.810,64235600	2,2894314930
385	10/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000,00	537,97194261	3,7176660000
369	11/09/2020	BRABESCO FIA IBOVESPA PLUS	500.000,00	0,00	638,02761023	783,6651455000
370	11/09/2020	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	500.000,00	41.331,65227033	12,0972662000
400	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	500.000,00	134.487,41466774	3,7178200000
378	14/09/2020	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	500.000,00	0,00	219.745,15714635	2,2753630000
386	14/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.000,00	806,92188351	3,7178320000
371	16/09/2020	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	275.806,80	22.803,79467946	12,0947765000
372	16/09/2020	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	524.193,20	43.340,46189278	12,0947765000

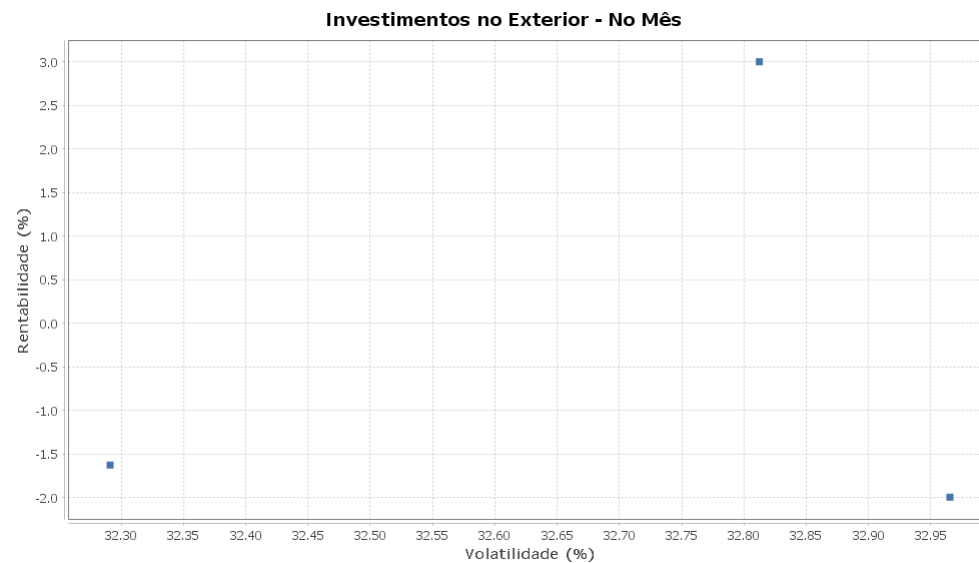
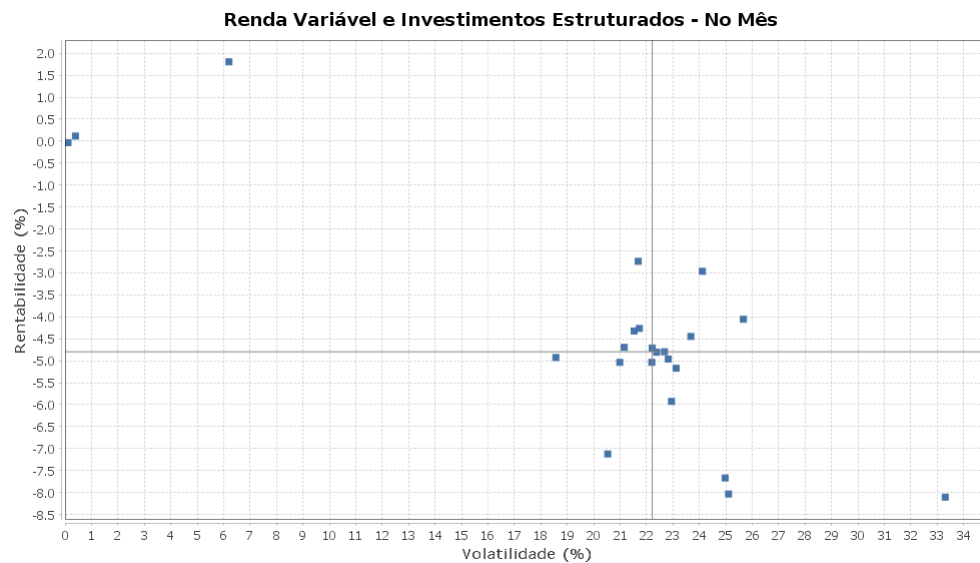
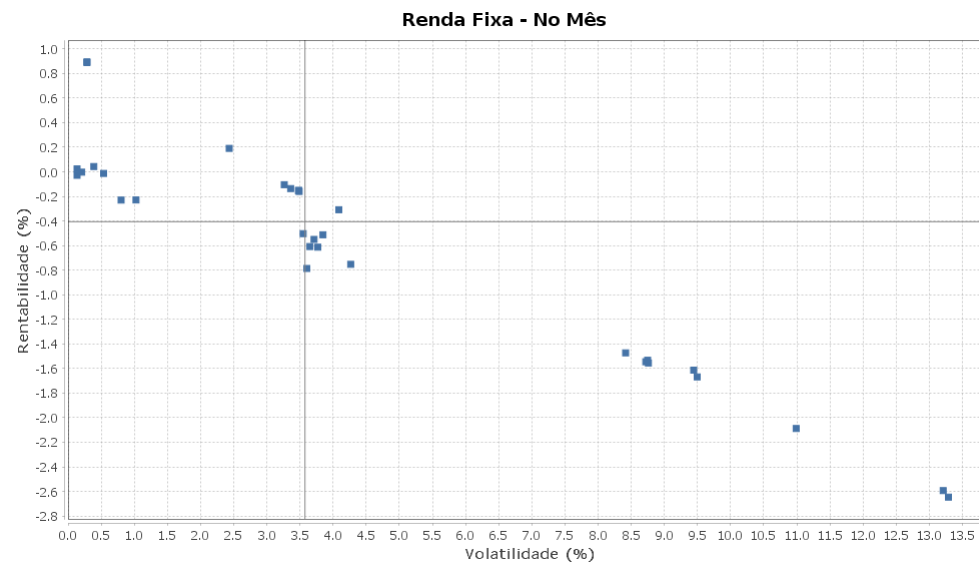
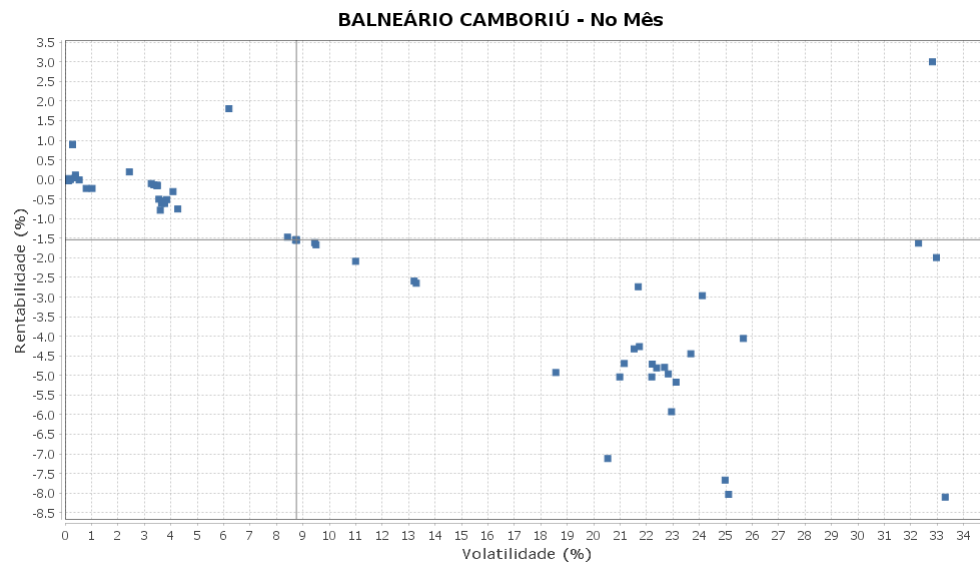
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
374	16/09/2020	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	500.000,00	0,00	156.381,76140785	3,1973038000
401	16/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	200.000,00	53.805,73332372	3,7170760000
402	16/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	300.000,00	80.708,59998558	3,7170760000
368	17/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.190,94	0,00	26.726,99663500	2,2894805890
373	17/09/2020	BRDESCO F I A SELECTION	100.000,00	0,00	118,76518176	841,9976168000
375	17/09/2020	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	100.000,00	0,00	9.461,18870905	10,5694964000
376	17/09/2020	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	100.000,00	0,00	10.246,67601929	9,7592624000
417	17/09/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	9.115,66998529	219,4024140000
419	17/09/2020	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	100.000,00	0,00	21.819,75918841	4,5830020000
410	17/09/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	100.000,00	0,00	58.718,63030574	1,7030370000
411	17/09/2020	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	100.000,00	0,00	54.004,42836313	1,8517000000
413	17/09/2020	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	100.000,00	0,00	26.798,83997469	3,7315048000
418	18/09/2020	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	2.000.000,00	0,00	9.984,09932342	200,3185200000
403	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	846.599,70	0,00	227.780,17832832	3,7167400000
404	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.984.745,29	0,00	1.072.107,62388545	3,7167400000
405	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	788.426,00	0,00	212.128,37056130	3,7167400000
412	18/09/2020	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	100.000,00	0,00	36.564,20097806	2,7349155000
366	21/09/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	20.000.000,00	13.509.554,48380400	1,4804337200
406	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	199.390,33	0,00	53.645,42368084	3,7168190000
363	22/09/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	20.000.000,00	0,00	999.547,00909300	20,0090639240
387	23/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	400,00	107,61447759	3,7169720000
388	23/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	69.844,05	18.790,57738396	3,7169720000
407	23/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	43.513,06	11.706,58805070	3,7169720000
408	28/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.540.540,53	952.527,39846909	3,7169960000
389	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	15.000,00	4.036,06085842	3,7164950000
390	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	26.401,30	7.103,81690275	3,7164950000
391	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	7.650,00	2.058,84474319	3,7156760000
409	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	113.975,38	0,00	30.674,19764264	3,7156760000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	0,12	0,23	-0,00	-1,65	-0,03	1.140.076,00	0,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,06	0,00	-0,97	0,02	8.909.972,05	1,63
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,05	0,00	-1,35	-0,03	2.508.398,48	0,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,21	0,08	0,00	-0,78	-0,00	10.416.809,39	1,90
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,28	0,13	-0,00	2,58	0,89	5.704.152,00	1,04
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,28	0,13	-0,00	2,60	0,89	2.840.314,00	0,52
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,39	0,30	-0,00	-0,29	0,04	11.136.414,19	2,03
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	0,39	0,31	-0,00	-0,11	0,11	610.050,06	0,11
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,27	0,00	-0,32	-0,01	1.999.389,66	0,36
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,80	0,04	0,00	-0,48	-0,23	1.944.621,74	0,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,02	0,41	0,01	-0,38	-0,23	25.097.727,28	4,58
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	0,55	0,00	0,01	0,19	275.836,30	0,05
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,26	0,92	0,00	-0,08	-0,10	859.913,36	0,16
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,36	1,16	0,00	-0,09	-0,14	3.194.341,87	0,58
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,03	0,06	-0,09	-0,15	49.176.856,95	8,97
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,01	0,00	-0,09	-0,15	3.054.177,86	0,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,03	-0,09	-0,16	25.937.404,65	4,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,02	-0,19	-0,50	12.776.209,56	2,33
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,60	1,28	0,01	-0,26	-0,79	4.436.959,18	0,81
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,31	0,02	-0,21	-0,61	9.598.332,11	1,75
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,71	1,38	0,02	-0,19	-0,55	10.064.625,46	1,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,77	1,39	0,00	-0,20	-0,61	45.941,96	0,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,85	1,35	0,01	-0,17	-0,51	3.409.982,86	0,62
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	4,09	1,32	0,01	-0,11	-0,31	6.494.968,64	1,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,04	-0,21	-0,75	19.666.635,75	3,59
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	6,20	0,63	0,00	0,27	1,81	90.801,94	0,02
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	8,42	3,11	0,01	-0,19	-1,47	2.382.528,83	0,43
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	8,72	3,22	0,02	-0,20	-1,55	3.269.853,26	0,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,75	3,24	0,31	-0,19	-1,53	65.217.711,28	11,90
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,76	3,22	0,20	-0,20	-1,56	43.437.136,99	7,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	9,44	3,52	0,12	-0,19	-1,61	24.002.258,66	4,38
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	9,50	3,28	0,06	-0,19	-1,67	12.482.142,95	2,28
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,99	3,74	0,01	-0,20	-2,09	1.136.818,31	0,21
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	13,21	5,06	0,02	-0,21	-2,59	2.678.045,63	0,49
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	13,29	5,16	0,03	-0,21	-2,65	4.174.717,83	0,76
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	10,57	0,04	-0,27	-4,93	2.052.425,35	0,37
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,53	12,36	0,06	-0,35	-7,12	2.643.850,59	0,48
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,98	10,57	0,13	-0,25	-5,04	7.500.347,12	1,37
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,16	11,35	0,18	-0,23	-4,70	8.957.252,92	1,63
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	21,53	10,42	0,03	-0,21	-4,32	1.653.836,96	0,30
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	21,68	11,03	0,16	-0,13	-2,74	8.728.814,58	1,59
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	21,73	10,79	0,08	-0,20	-4,26	4.000.793,38	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,20	11,47	0,37	-0,23	-5,04	18.961.436,64	3,46
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,22	11,46	0,23	-0,22	-4,71	11.711.151,48	2,14
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	22,38	11,57	0,13	-0,22	-4,81	6.690.577,05	1,22
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	22,68	10,74	0,11	-0,22	-4,80	9.936.311,66	1,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,82	12,64	0,18	-0,22	-4,96	8.416.636,86	1,54
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,95	15,77	0,27	-0,27	-5,93	10.395.452,55	1,90
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,12	15,39	0,39	-0,23	-5,17	14.964.934,10	2,73
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,67	12,50	0,06	-0,19	-4,45	2.886.359,81	0,53
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,11	12,00	0,15	-0,13	-2,97	7.600.875,99	1,39
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,97	13,69	0,08	-0,31	-7,67	3.561.349,51	0,65
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,10	14,72	0,12	-0,33	-8,03	4.723.745,54	0,86
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	25,66	11,82	0,06	-0,16	-4,06	3.029.068,41	0,55
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	32,29	12,11	0,00	-0,06	-1,63	3.225.645,78	0,59
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	32,81	15,36	-0,08	0,09	3,00	12.703.969,46	2,32
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	32,97	12,73	0,01	-0,07	-1,99	9.677.155,09	1,77
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	33,30	19,03	0,06	-0,25	-8,11	2.060.660,77	0,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de setembro 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;