



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
OUTUBRO 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 25.01.2021.

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

69,09%

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	12,29	0,17	-0,67	2.386.595,38	0,44	209.581.871,47	1,14
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,00	0,18	4,56	3.059.543,65	0,56	1.324.812.410,20	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,72	0,18	-0,73	3.275.759,58	0,60	371.278.279,20	0,88
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,77	0,20	-0,73	43.522.189,70	7,96	5.529.359.748,67	0,79
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,83	0,19	-0,81	65.343.924,19	11,94	5.818.645.931,87	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,52	0,03	1,95	9.600.946,03	1,75	1.166.280.336,00	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	0,18	4,48	24.885.027,83	4,55	18.309.382.329,52	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,71	0,20	-5,20	4.183.268,17	0,76	1.936.566.655,94	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,41	0,02	1,65	4.437.656,24	0,81	532.535.176,29	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,03	-0,36	4,04	45.777,15	0,01	9.226.615.794,13	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,00	0,19	4,50	49.268.655,75	9,01	4.413.688.996,03	1,12
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,13	0,26	5,31	3.202.796,54	0,59	286.802.710,47	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,40	0,49	3,15	277.194,80	0,05	240.126.324,03	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	1,78	19.652.822,43	3,59	9.938.464.189,22	0,20
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	12.762.435,34	2,33	13.635.004.724,81	0,09
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,68	-0,26	-0,23	1.133.892,49	0,21	1.650.990.263,48	0,07
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,18	0,29	3,88	862.378,90	0,16	571.777.072,59	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	1,31	7,58	5.778.668,00	1,06	194.340.394,17	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,41	1,31	7,64	2.877.584,00	0,53	220.108.170,04	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,45	0,18	1,54	256.557.116,17	46,90		

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	0,27	0,11	2,06	2.511.123,22	0,46	7.654.806.493,77	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	14,59	-0,00	0,38	12.482.080,64	2,28	640.033.097,32	1,95
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	0,12	1,40	11.116.780,31	2,03	4.647.429.126,31	0,24
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,97	0,08	2,81	3.412.717,43	0,62	766.439.026,51	0,45
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	1,98	8.510.775,87	1,56	2.401.972.433,04	0,35
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,92	0,21	9,60	2.683.557,25	0,49	240.149.931,32	1,12
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,46	0,06	-0,43	24.017.040,26	4,39	831.589.325,82	2,89
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,08	2,55	25.117.203,64	4,59	4.590.560.763,79	0,55
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,71	-0,74	5,66	9.989.925,55	1,83	996.897.363,36	1,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,02	0,44	6,44	11.185.423,54	2,04	759.229.092,37	1,47
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,14	-0,37	5,11	6.470.736,05	1,18	84.086.459,32	7,70
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1,34	0,06	0,03	2.000.556,58	0,37	531.917.052,79	0,38
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,79	0,03	2,35	119.497.920,34	21,84		

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	29,10	-0,22	-2,19	1.940.291,96	0,35	109.574.441,36	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			29,10	-0,22	-2,19	1.940.291,96	0,35		
Renda Fixa			7,68	0,13	1,72	377.995.328,47	69,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,01%

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	44,75	-0,73	-18,88	6.641.867,15	1,21	302.445.334,13	2,20
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,29	-0,74	-18,75	11.624.966,44	2,12	629.629.945,87	1,85
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,43	-0,73	-18,82	18.266.833,59	3,34		

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	43,83	-0,17	-16,48	1.651.066,92	0,30	14.179.915,33	11,64
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	43,96	3,33	-17,49	9.019.385,94	1,65	713.271.813,28	1,26
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	47,69	-2,47	-24,78	14.595.122,99	2,67	460.594.339,04	3,17
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,79	-1,45	-24,73	8.827.021,08	1,61	871.977.000,93	1,01
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	41,51	-0,93	-25,69	7.430.537,28	1,36	1.536.915.263,29	0,48
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,96	-2,46	-16,71	18.494.218,43	3,38	1.939.742.217,75	0,95
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,30	-1,33	-17,14	3.947.646,33	0,72	792.105.434,37	0,50
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	60,99	-2,61	-42,83	2.006.842,98	0,37	446.512.416,44	0,45
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,78	-1,73	-5,68	7.469.351,86	1,37	2.238.639.550,31	0,33
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,73	0,43	-15,33	2.898.632,37	0,53	839.309.475,04	0,35
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	44,47	-2,89	-18,03	2.567.336,32	0,47	955.035.829,40	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	46,15	-2,98	-18,78	2.938.824,85	0,54	713.552.022,73	0,41
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,50	0,05	-17,54	2.053.489,97	0,38	793.160.820,76	0,26
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,35	-2,40	-22,29	10.145.577,24	1,85	1.154.693.546,75	0,88
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,90	0,50	-20,29	8.458.544,75	1,55	3.130.548.860,93	0,27
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,33	-4,17	-35,96	4.526.788,37	0,83	1.442.025.574,85	0,31
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	40,85	-1,91	60,96	3.493.332,76	0,64	1.024.468.138,58	0,34
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,50	-1,44	-20,80	110.523.720,44	20,20		

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	32,37	-2,30	-1,22	9.708.269,79	1,77	571.445.122,37	1,70
Sub-total Artigo 8º III			32,37	-2,30	-1,22	9.708.269,79	1,77		

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	66,18	0,01	-1,96	848.402,34	0,16	14.745.453,20	5,75
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	87,29	-0,14	-32,09	1.143.879,40	0,21	61.323.689,95	1,87
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			63,22	-0,08	-19,48	1.992.281,74	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	27,01	-1,31	-21,25	1.125.180,00	0,21	140.712.001,53	0,80
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	51,98	-3,11	-36,49	591.091,56	0,11	588.319.069,28	0,10
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,13	3,84	-29,02	94.292,75	0,02	15.335.692,09	0,61
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			38,98	-1,65	-27,36	1.810.564,31	0,33		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,10	-1,39	-19,05	142.301.669,87	26,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,89%

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	28,43	-0,49	49,06	3.712.431,95	0,68	140.713.941,41	2,64
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,79	-1,03	66,14	13.558.283,19	2,48	961.802.326,50	1,41
Sub-total Artigo 9º A, II			29,39	-0,90	62,26	17.270.715,14	3,16		

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	29,24	-1,77	50,05	9.505.692,90	1,74	1.678.449.679,91	0,57
Sub-total Artigo 9º A, III			29,24	-1,77	50,05	9.505.692,90	1,74		
Investimentos no Exterior			26,27	-1,26	60,43	26.776.408,04	4,89		
Total			14,82	-0,33	-3,19	547.073.406,38	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	256.557.116,17	46,90	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	119.497.920,34	21,84	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.940.291,96	0,35	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	377.995.328,47	69,09				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	18.266.833,59	3,34	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	110.523.720,44	20,20	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	9.708.269,79	1,77	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.992.281,74	0,36	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.810.564,31	0,33	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	142.301.669,87	26,01				35,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	17.270.715,14	3,16	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.505.692,90	1,74	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	26.776.408,04	4,89				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

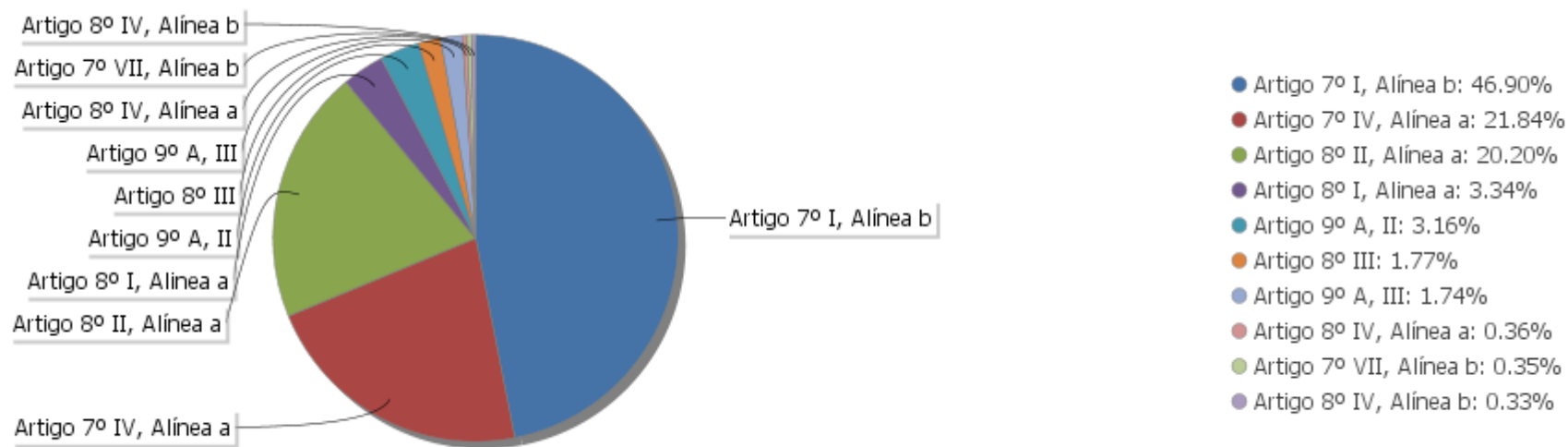
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,18 116,62	1,54 63,35	-1,68 -353,23	3,87 344,99	1,17 36,41	468.274,12	4.274.318,88
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,03 18,05	2,35 96,58	-1,34 -283,22	2,67 238,38	2,04 63,62	18.228,79	2.523.981,67
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,22 -141,84	-2,19 -89,87	-0,59 -124,25	-1,16 -103,82	30,21 940,74	-4.329,78	-44.124,13
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,73 -0,04	-18,82 -0,06	-8,70 0,01	16,43 -0,27	-12,44 -0,06	-134.894,94	-3.206.849,55
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,44 -0,75	-20,80 -2,04	-8,46 0,25	16,23 -0,47	-12,07 0,30	-1.614.120,64	-26.619.278,83
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-2,30 -1,61	-1,22 17,53	-0,60 8,11	11,39 -5,31	5,21 17,58	-228.041,87	157.476,78
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 0,61	-19,48 -0,72	-0,24 8,47	-13,09 -29,79	-15,93 -3,55	-1.512,40	-197.584,85
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,65 -0,96	-27,36 -8,61	1,10 9,81	4,00 -12,70	-5,18 7,19	-30.363,69	-682.642,75
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,90 -573,93	62,26 3.619,92	16,34 3.443,40	35,14 3.133,01		-158.900,10	4.270.715,14
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,77 -1.128,76	50,05 2.054,64	10,87 2.289,65	21,16 1.886,70	60,56 1.886,09	-171.462,19	2.861.822,90
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						-1.857.122,70	-16.662.164,74

Análise de Liquidez

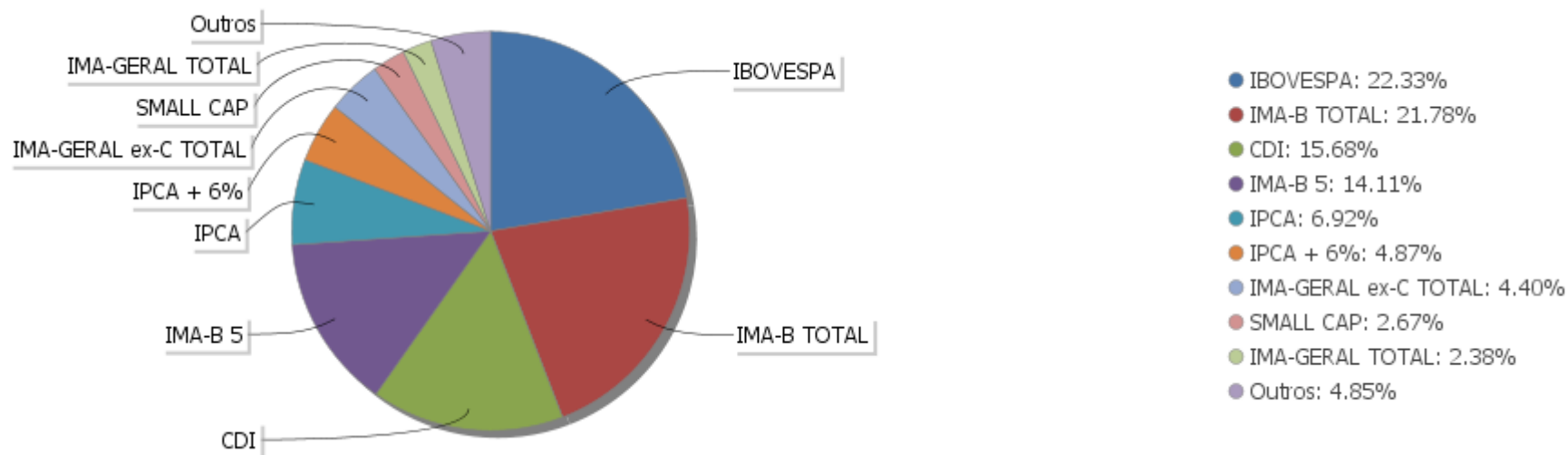
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	509.572.439,17	93,15	509.572.439,17	93,15
de 31 a 364 dias	23.447.355,27	4,29	533.019.794,44	97,43
acima de 365 dias	14.053.611,94	2,57	547.073.406,38	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

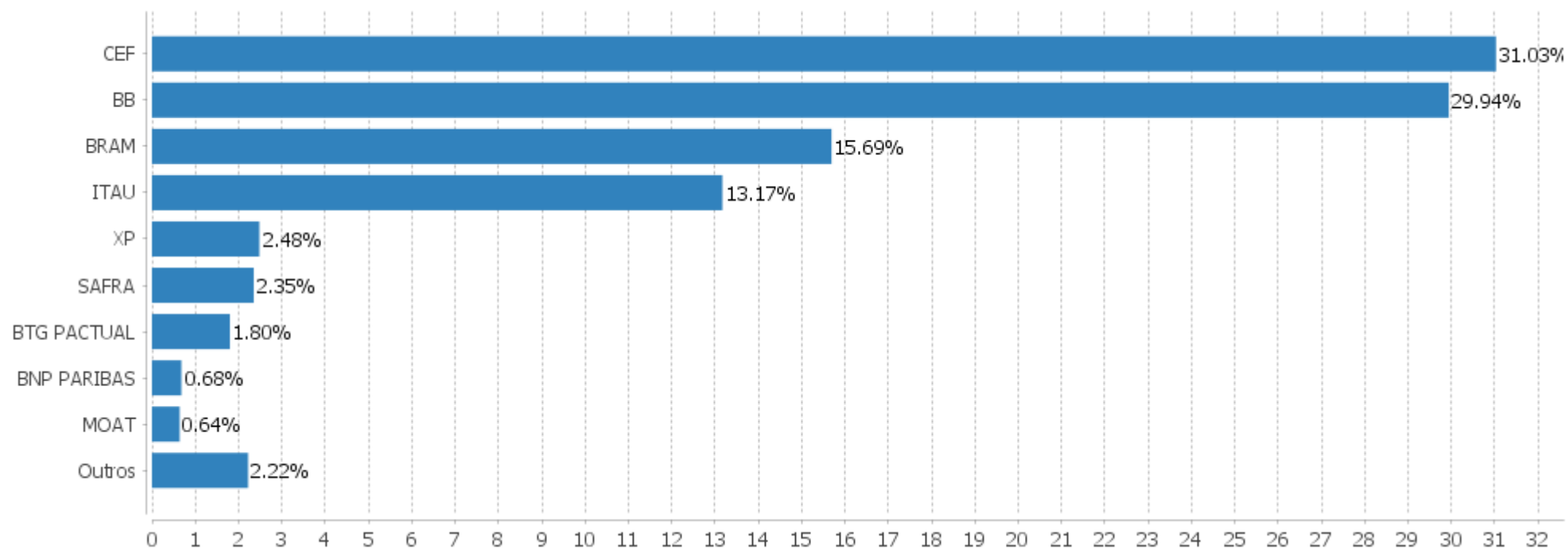


Alocação Por Estratégia



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	-0,33			-3,19
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34			7,17
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02	-1,20	-3,01	-1,67			-10,36
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

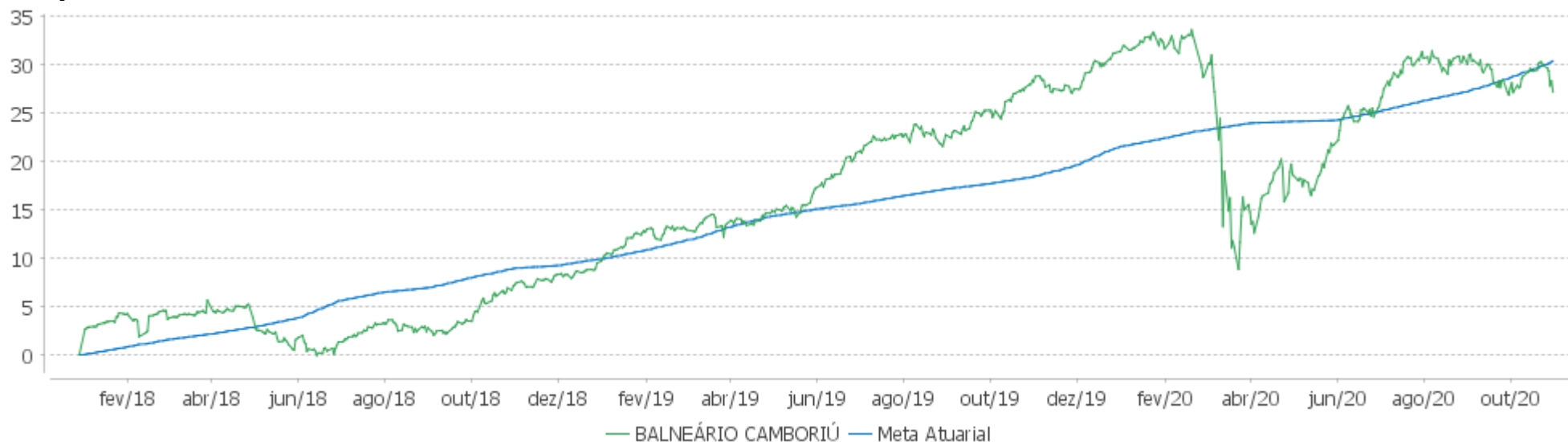
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

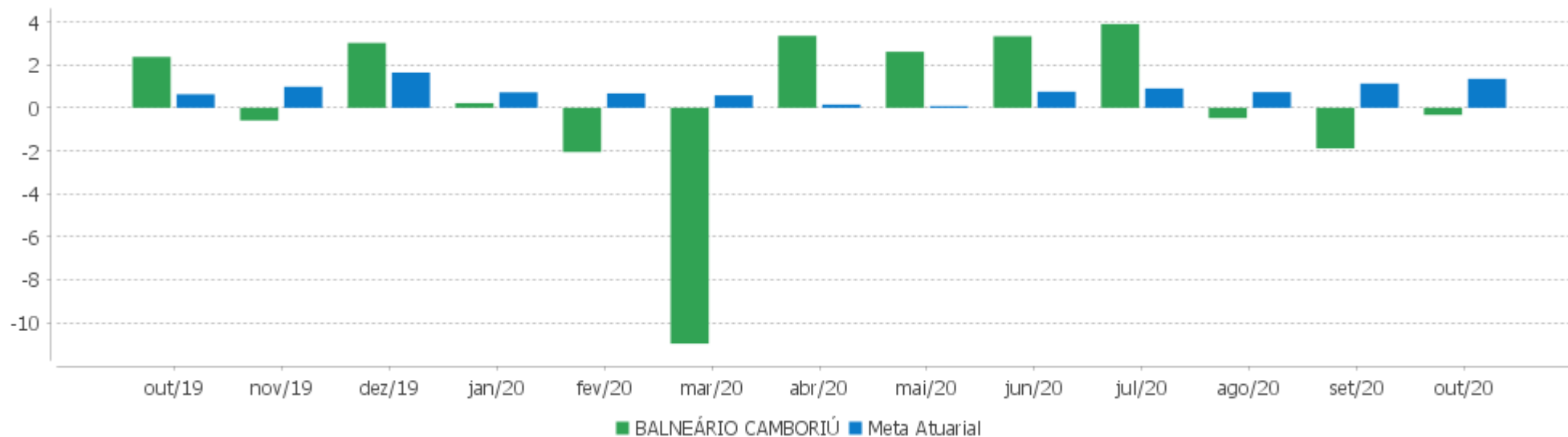
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	52,94	03 meses	-2,69	3,21	-5,90	7,63
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	47,06	06 meses	7,20	4,97	2,23	7,86
			12 meses	-0,85	9,99	-10,84	14,82
			24 meses	18,60	19,55	-0,94	10,91
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2018-01	Desde 29/12/2017	27,19	30,27	-3,09	9,75
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
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	0,06 39,23	-0,43 -17,48	-3,57 -752,43	4,99 445,38	-1,18 -36,89	27,10 281,80	41,48 247,02
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-0,00 -0,32	0,38 15,71	-3,55 -748,56	4,37 389,24	-0,41 -12,91	28,07 291,97	40,76 242,73
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,11 69,20	2,06 84,53	0,23 47,70	0,83 74,03	2,80 87,28	9,00 93,56	15,92 94,82
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,74 -472,83	5,66 232,25	-1,67 -352,87	1,11 99,18	5,80 180,63	20,98 218,25	33,64 200,32
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 101,53	1,98 81,34	0,36 76,91	1,12 100,00	2,69 83,84	8,87 92,26	15,98 95,19
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF % do CDI	0,06 37,18	2,57 105,71	0,11 23,65	1,30 116,13	3,10 96,58		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,12 76,62	1,89 77,49	0,26 55,37	1,09 96,90	2,56 79,77	8,75 91,05	15,66 93,26
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6% p.p.	-0,37 -1,72	5,11 -2,16	-0,03 -3,27	4,78 -0,25	5,82 -4,28	23,98 4,31	
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI	0,44 280,36	6,44 264,23	0,87 183,79	1,47 131,42	7,89 245,75	19,51 202,94	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,21 -0,01	-5,11 -0,76	-6,03 -0,11	4,67 -0,23	-6,64 -0,79	27,47 -1,52	40,87 -2,14
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,08 -0,01	2,81 0,31	-1,05 0,06	3,03 0,40	2,93 0,26	18,31 0,44	28,80 0,44
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,08 -0,78	2,55 0,33	-0,28 -2,03	1,25 -0,74	3,26 -0,66	17,36 10,81	25,35 13,94
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 0,05	5,31 5,82	0,59 3,67	5,46 0,65	6,03 7,04	23,67 -1,80	35,60 -2,78
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,02	-0,81 -0,30	-3,15 -0,07	4,68 -0,13	-1,41 -0,40	24,69 -0,78	37,24 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,02	4,48 -0,24	0,41 -0,09	4,66 -0,15	5,38 -0,33	19,69 -0,58	30,54 -0,92
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,03	4,56 -0,16	0,43 -0,07	4,64 -0,17	5,52 -0,19	19,72 -0,56	30,32 -1,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,19	4,50	0,40	4,62	5,42	19,71	30,59

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.	-0,01	-0,22	-0,10	-0,19	-0,29	-0,56	-0,88
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	0,17	-0,67	-3,10	4,39	-1,26	24,69	37,10
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,16	-0,02	-0,42	-0,25	-0,78	-1,29
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,29	3,88	0,61	4,32	4,97	18,91	40,24
Var. INPC + 6% p.p.	-1,09	-4,17	-3,03	-1,37	-6,04	-1,76	7,26
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,03	1,95	-1,30	2,19	2,10	16,74	26,61
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,06	-0,55	-0,19	-0,45	-0,57	-1,13	-1,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,36	4,04	-1,73	1,50	4,16	19,08	30,28
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,23	-0,10	-0,14	-0,28	-0,70	-0,80
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,31	7,58	2,99	4,42	9,81	19,61	32,66
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,04	0,30	-0,25	-0,61	-0,29	-0,06	0,09
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,18	-0,73	-3,15	4,61	-1,25	24,65	36,83
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,22	-0,08	-0,21	-0,25	-0,82	-1,56
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	-0,26	-0,23	-4,32	4,03	-0,55	28,23	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47	0,28	-1,24	-0,78	0,46	2,77	
BB PREV RF VII	0,49	3,15	1,16	3,77	4,54	15,45	26,10
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,28	3,66	4,23	-1,05	5,55	-10,01	-12,29
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,07	1,78	-1,70	2,07	1,80	17,32	27,46
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07	-0,17	-0,31	-0,07	-0,37	0,22	0,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	-0,11	4,42	-1,16	1,94	4,51	23,65	32,48
Var. IPCA p.p.	-0,97	2,20	-2,91	-0,06	0,59	17,10	21,07
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	1,31	7,64	3,01	4,46	9,89	19,77	32,95
Var. INPC + 6% p.p.	-0,07	-0,41	-0,62	-1,24	-1,12	-0,90	-0,03
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,20	-0,73	-3,19	4,62	-1,29	24,83	37,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,23	-0,11	-0,19	-0,28	-0,64	-1,07
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,02	1,65	-1,49	1,99	1,82	16,42	26,24
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,02	-0,30	-0,10	-0,15	-0,34	-0,67	-0,96
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,20	-4,62	-6,05	4,65	-6,05	28,32	41,82
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,28	-0,12	-0,25	-0,20	-0,66	-1,20
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	-0,22	-2,19	-0,59	-1,16	30,21	29,81	-23,80
% do CDI	-141,84	-89,87	-124,25	-103,82	940,74	310,01	-141,75
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-0,74	-18,75	-8,66	16,40	-12,35	7,01	25,13
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	0,01	0,05	-0,31	0,03	-0,45	-1,30
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-0,73	-18,99	-8,78	16,49	-12,59	7,00	25,66
Var. IBOVESPA p.p.	-0,04	-0,23	-0,07	-0,21	-0,22	-0,47	-0,77
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	3,84	-29,02	5,88	8,96	-42,56	-45,60	

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.	4,85	-15,55	4,65	2,69	-41,66	-68,98	
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	-1,31	-21,25	1,28	3,81	-1,04	20,38	
Var. IFIX p.p.	-0,30	-7,78	0,05	-2,45	-0,13	-3,01	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	-3,11	-36,49	0,05	3,61	-2,57	12,08	
Var. IFIX p.p.	-2,10	-23,02	-1,18	-2,65	-1,66	-11,30	
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	0,01	-1,96	0,15	-1,03	17,89	133,55	167,05
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,34	-9,23	-3,09	-6,06	7,79	113,88	134,48
FIP CAIXA CYRELA	-0,14	-32,09	-0,52	-24,76	-32,12	-37,42	
Var. IBOVESPA p.p.	0,55	-13,33	8,19	-41,47	-19,74	-44,89	
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	-2,47	-24,78	-8,86	19,47	-11,83	21,53	26,96
Var. SMALL CAP p.p.	-0,19	-4,00	-0,12	-0,69	-5,66	-12,55	-14,56
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-2,89	-18,03	-12,40	10,59	-10,48	21,24	56,04
Var. IBOVESPA p.p.	-2,21	0,73	-3,70	-6,12	1,89	13,78	29,61
BRADESCO F I A SELECTION	3,33	-17,49	-0,65	28,48	-12,83	6,67	36,20
Var. IBOVESPA p.p.	4,02	1,27	8,06	11,78	-0,46	-0,80	9,76
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-4,17	-35,96	-15,33	9,64	-27,31	-4,47	14,77
Var. IBOVESPA p.p.	-3,48	-17,20	-6,62	-7,06	-14,93	-11,94	-11,66
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	0,43	-15,33	-7,04	20,08	-7,57	13,58	37,99
Var. IBOVESPA p.p.	1,11	3,43	1,67	3,38	4,80	6,11	11,56
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-2,61	-38,62	-17,66	4,95	-26,84	10,64	12,90
% do CDI	-1.663,80	-1.585,58	-3.720,38	441,21	-835,88	110,65	76,84
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,50	-20,29	-4,68	18,03	-12,18	19,23	43,68
Var. IBOVESPA p.p.	1,19	-1,54	4,03	1,32	0,20	11,76	17,25
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,05	-17,54	-8,51	11,41	-10,04	27,58	34,92
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,60	3,02	0,13	0,08	0,54	3,08	3,96
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	-0,17	-15,61	-7,29	18,41	-8,92	15,74	40,28
Var. IBRX 100 p.p.	0,38	2,27	1,02	0,86	2,13	4,73	10,36
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	-0,93	-25,69	-10,79	7,18	-20,35	-5,29	14,17
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,58	-5,12	-2,15	-4,16	-9,77	-29,79	-16,79
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-1,73	-5,68	-5,06	25,13	1,35	39,74	63,12
Var. IBOVESPA p.p.	-1,04	13,08	3,65	8,42	13,73	32,27	36,69
FIA CAIXA CONSUMO	-2,98	-12,73	-8,40	16,20	-2,43	39,56	22,16
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,12	-0,88	-0,32	-1,04	-0,50	-2,64	-5,35
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-1,91	60,96	-12,76	24,38			
Var. IBOVESPA p.p.	-1,22	23,46	-4,05	7,68			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,40	-22,29	-9,46	17,01	-8,36	26,57	31,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,72	-3,53	-0,75	0,31	4,01	19,10	5,45
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-1,33	-17,14	-8,38	16,50	-9,12	15,39	32,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,64	1,62	0,32	-0,20	3,26	7,92	6,14
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-1,45	-24,73	-9,28	8,19	-18,47	2,43	13,58
Var. IBOVESPA p.p.	-0,77	-5,97	-0,58	-8,51	-6,10	-5,04	-12,86
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,46	-16,71	-8,84	13,66	-5,27	30,39	57,34
Var. IBOVESPA p.p.	-1,78	2,05	-0,13	-3,04	7,10	22,92	30,91
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-2,30	-1,22	-0,60	11,39	5,21	21,82	33,51
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	17,53	8,11	-5,31	17,58	14,35	7,07
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,77	50,05	10,87	21,16	60,56	94,90	135,92
Var. IBOVESPA p.p.	-1,08	68,81	19,57	4,46	72,93	87,43	109,48
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-0,49	68,63	11,52	24,97	81,38	119,27	
Var. IBOVESPA p.p.	0,20	87,39	20,23	8,27	93,75	111,80	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,03	84,34	17,49	37,99			
Var. IPCA + 6% p.p.	-2,38	77,07	14,25	32,96			
BALNEÁRIO CAMBORIÚ	-0,33	-3,19	-2,69	7,20	-0,85	18,60	
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,68	-10,46	-5,93	2,17	-10,96	-1,06	
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
424	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	900.000,00	0,00	242.350,60700749	3,7136280000
425	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	194.862,81	52.472,35587409	3,7136280000
431	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	105.000,00	28.274,23748421	3,7136280000
432	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	322.000,00	86.707,66161823	3,7136280000
433	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	130.060,61	35.022,51975696	3,7136280000
447	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	900.000,00	287.927,02777408	3,1257920000
434	02/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	533.962,64	143.898,82611844	3,7106810000
448	02/10/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	197.000,00	63.223,98685968	3,1159060000
435	05/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	269.663,74548920	3,7083220000
436	05/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	113.853,41	30.702,13697732	3,7083220000
420	05/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500.000,00	218.775,65170500	2,2854462830
426	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	13.500,00	3.640,29368272	3,7084920000
449	06/10/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	5.193,25848865	192,5573322000
423	06/10/2020	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	582,68237923	858,1004297000
421	09/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	26.871,31	0,00	11.737,72786000	2,2893110420
427	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.689,11684831	3,7186930000
437	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	226.823,58	0,00	60.995,51105725	3,7186930000
428	19/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	70.000,00	18.822,40576159	3,7189720000
438	19/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.626.264,27	0,00	1.243.963,18928994	3,7189720000
439	19/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.687,56	0,00	722,66206898	3,7189720000
440	19/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.688,91510880	3,7189720000
441	20/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	77.183,78	0,00	20.751,71963590	3,7193920000
442	20/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	951.901,72	0,00	255.929,38845919	3,7193920000
422	20/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.190,94	0,00	26.701,88320500	2,2916338720
443	21/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	303,25	0,00	81,53365545	3,7193230000
429	23/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.200,00	322,63138155	3,7194150000
444	23/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.192,89	589,57927524	3,7194150000
445	26/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.544.378,70	952.882,44369951	3,7196390000

Carteira: BALNEÁRIO CAMBORIÚ

Data Extrato: 30/10/2020

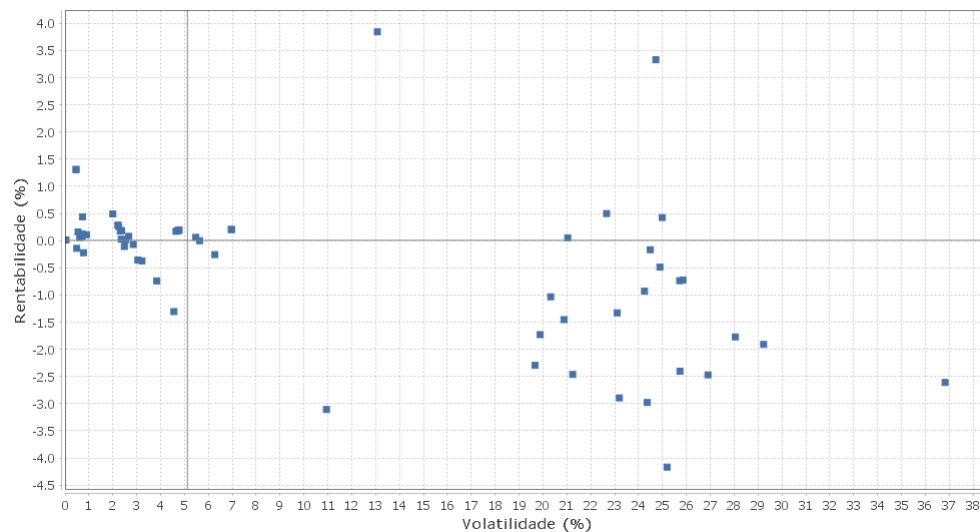
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
430	28/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	28.259,05	7.596,43917712	3,7200390000
446	28/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	15.000,00	4.032,21579129	3,7200390000
Total						

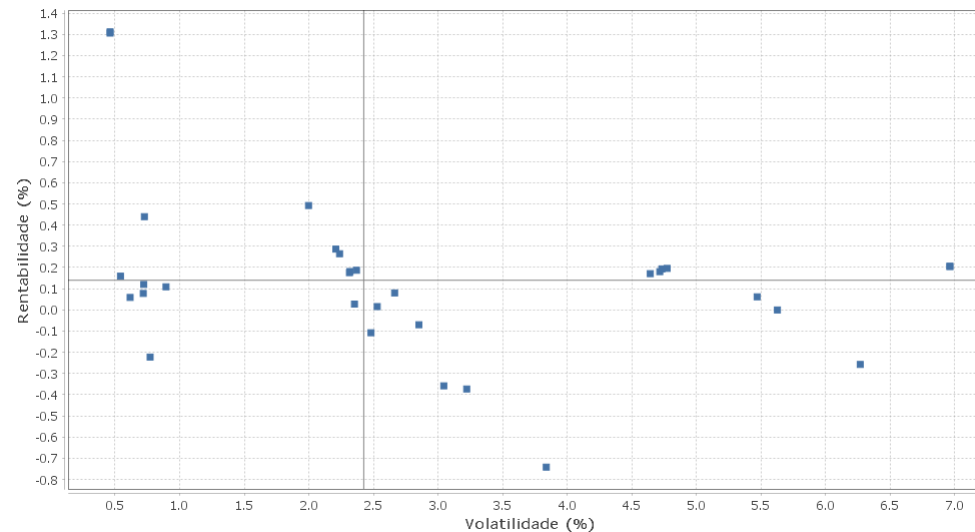
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

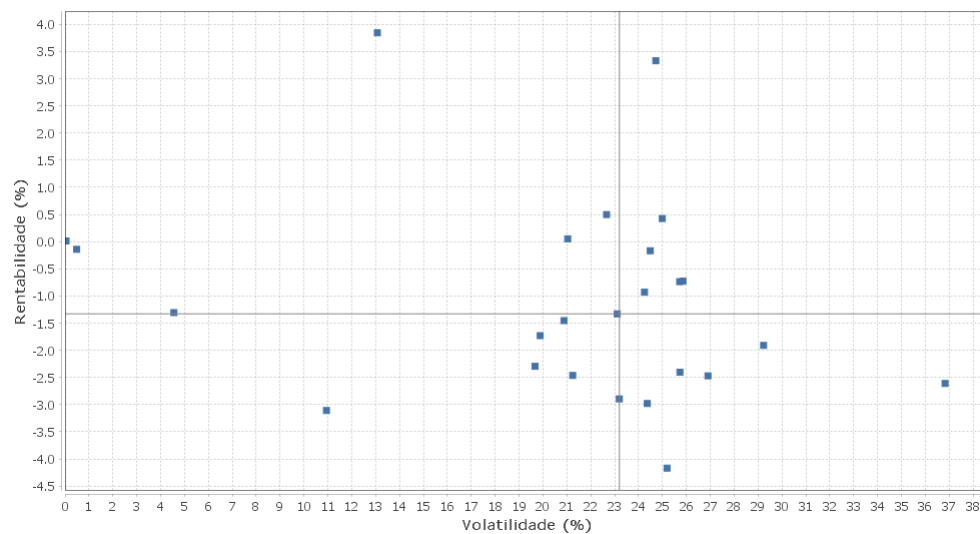
BALNEÁRIO CAMBORIÚ - No Mês



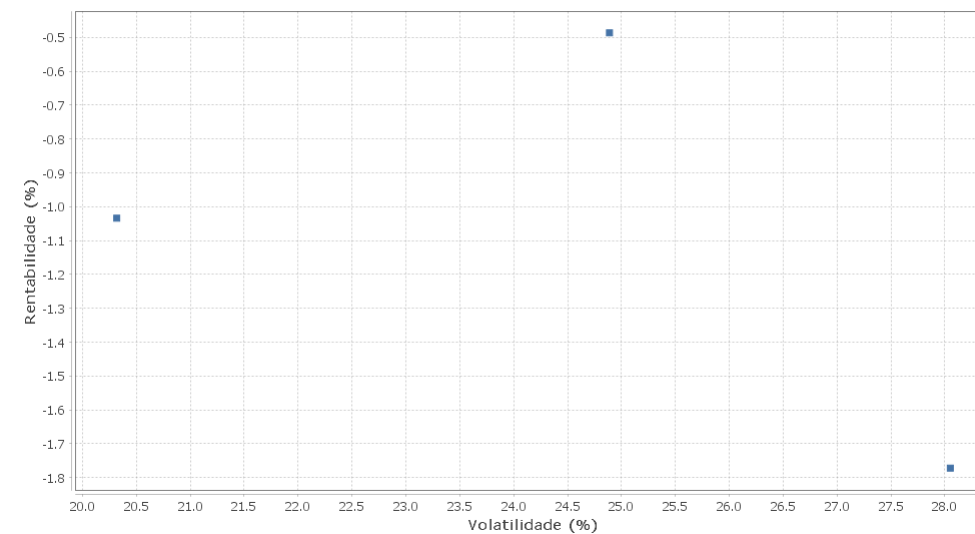
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 18.779.225,08

Value-At-Risk: 3,43%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GÂVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,04	0,04	-0,00	-3,36	0,01	848.402,34	0,16
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,09	-0,00	2,50	1,31	2.877.584,00	0,53
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,09	-0,00	2,49	1,31	5.778.668,00	1,06
FIP CAIXA CYRELA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,49	1,30	0,00	-0,61	-0,14	1.143.879,40	0,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,10	0,00	0,00	0,16	8.510.775,87	1,56
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,62	0,28	0,00	-0,16	0,06	2.000.556,58	0,37
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,72	0,33	0,01	-0,11	0,08	25.117.203,64	4,59
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,72	0,13	0,00	-0,05	0,12	11.116.780,31	2,03
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,73	0,30	-0,00	0,39	0,44	11.185.423,54	2,04
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,77	0,05	0,00	-0,49	-0,22	1.940.291,96	0,35
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,89	0,11	0,00	-0,05	0,11	2.511.123,22	0,46
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,00	0,89	0,00	0,17	0,49	277.194,80	0,05
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	1,06	0,00	0,06	0,29	862.378,90	0,16
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,24	1,11	0,00	0,05	0,26	3.202.796,54	0,59
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,31	1,04	0,00	0,01	0,18	3.059.543,65	0,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,02	0,03	0,01	0,18	24.885.027,83	4,55
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,16	0,02	-0,06	0,03	9.600.946,03	1,75
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,37	1,09	0,06	0,01	0,19	49.268.655,75	9,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,02	-0,11	-0,11	12.762.435,34	2,33
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,53	1,17	0,01	-0,06	0,02	4.437.656,24	0,81
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,66	1,19	0,01	-0,03	0,08	3.412.717,43	0,62
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,04	-0,08	-0,07	19.652.822,43	3,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	1,36	0,00	-0,17	-0,36	45.777,15	0,01
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	3,22	1,42	0,01	-0,16	-0,37	6.470.736,05	1,18
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,84	1,43	0,02	-0,23	-0,74	9.989.925,55	1,83
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	4,56	0,16	0,00	-0,32	-1,31	1.125.180,00	0,21
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,64	3,04	0,01	0,00	0,17	2.386.595,38	0,44
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,72	3,14	0,01	0,01	0,18	3.275.759,58	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,73	3,16	0,28	0,01	0,19	65.343.924,19	11,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	3,15	0,19	0,01	0,20	43.522.189,70	7,96
BRADERCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,47	3,26	0,11	-0,02	0,06	24.017.040,26	4,39
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,63	3,35	0,06	-0,03	-0,00	12.482.080,64	2,28
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	3,72	0,01	-0,07	-0,26	1.133.892,49	0,21
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	6,96	4,93	0,02	0,01	0,21	2.683.557,25	0,49
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,96	4,93	0,03	0,01	0,20	4.183.268,17	0,76
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	10,94	0,04	0,00	-0,30	-3,11	591.091,56	0,11
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	13,07	0,31	-0,00	0,28	3,84	94.292,75	0,02
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	19,66	10,23	0,10	-0,12	-2,30	9.708.269,79	1,77
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,88	10,10	0,13	-0,09	-1,73	7.469.351,86	1,37
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	20,32	13,01	-0,02	-0,06	-1,03	13.558.283,19	2,48
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,87	9,39	0,14	-0,08	-1,45	8.827.021,08	1,61
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,03	9,83	0,03	-0,00	0,05	2.053.489,97	0,38
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,24	9,95	0,31	-0,12	-2,46	18.494.218,43	3,38
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,66	10,26	0,15	0,02	0,50	8.458.544,75	1,55
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	23,11	11,02	0,08	-0,06	-1,33	3.947.646,33	0,72
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,20	9,99	0,04	-0,13	-2,89	2.567.336,32	0,47
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	24,25	10,40	0,13	-0,04	-0,93	7.430.537,28	1,36
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	24,36	11,19	0,05	-0,13	-2,98	2.938.824,85	0,54
BRADERCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	24,49	9,95	0,03	-0,01	-0,17	1.651.066,92	0,30
BRADERCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	24,72	10,79	0,16	0,13	3,33	9.019.385,94	1,65
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,89	11,85	0,02	-0,03	-0,49	3.712.431,95	0,68
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,99	11,15	0,06	0,01	0,43	2.898.632,37	0,53
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,19	11,25	0,08	-0,17	-4,17	4.526.788,37	0,83
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	25,72	10,22	0,20	-0,03	-0,74	11.624.966,44	2,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	25,73	12,41	0,21	-0,10	-2,40	10.145.577,24	1,85
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	25,85	10,28	0,12	-0,03	-0,73	6.641.867,15	1,21
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	26,90	12,29	0,30	-0,10	-2,47	14.595.122,99	2,67
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	28,05	13,17	0,06	-0,07	-1,77	9.505.692,90	1,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,23	11,76	0,07	-0,07	-1,91	3.493.332,76	0,64
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	36,82	17,94	0,05	-0,08	-2,61	2.006.842,98	0,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de outubro 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;