



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
DEZEMBRO 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 **67,13%**

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	12,28	4,81	6,11	2.549.413,13	0,42	273.860.018,07	0,93
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,01	1,75	7,76	3.153.295,88	0,53	1.514.027.343,81	0,21
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,72	4,76	6,04	3.499.203,80	0,58	407.641.897,16	0,86
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,77	4,77	6,08	46.508.798,65	7,75	8.683.958.095,83	0,54
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,83	4,78	6,00	69.825.683,76	11,63	6.189.324.594,61	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,53	2,08	4,79	9.869.036,47	1,64	1.195.165.624,38	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	1,76	7,69	25.371.217,43	4,23	20.749.654.166,95	0,12
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,74	7,41	4,35	4.605.111,97	0,77	1.613.945.826,86	0,29
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,42	2,10	4,50	4.562.075,21	0,76	568.891.574,00	0,80
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,07	1,95	6,42	34.254,20	0,01	3.566.529.273,20	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,00	1,75	7,72	50.790.358,16	8,46	4.983.065.144,99	1,02
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,11	1,60	8,39	3.296.323,42	0,55	295.177.816,54	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,44	1,15	5,55	283.658,95	0,05	245.726.044,50	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	2,35	5,06	20.285.115,01	3,38	9.563.044.096,34	0,21
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	1,29	6,63	13.032.917,99	2,17	14.717.510.150,97	0,09
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,71	5,50	7,53	1.222.151,65	0,20	1.814.884.714,10	0,07
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,55	6,86	887.064,46	0,15	588.144.165,54	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,45	1,60	10,69	5.946.092,00	0,99	199.970.936,06	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,45	1,61	10,77	2.961.288,00	0,49	226.510.764,59	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,42	3,25	6,46	268.683.060,14	44,76		

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	0,20	2,38	4.348.497,97	0,72	6.759.752.309,58	0,06

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	14,58	4,88	7,47	13.363.645,63	2,23	636.959.466,44	2,10
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,19	0,09	0,09	2.668.266,09	0,44	19.557.818.028,60	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,36	1,92	16.267.975,43	2,71	4.230.190.650,43	0,38
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,98	2,05	5,81	3.512.452,94	0,59	763.750.367,10	0,46
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,24	2,39	8.372.942,32	1,39	2.587.899.557,62	0,32
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,94	7,38	20,63	2.953.659,15	0,49	221.183.335,18	1,34
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,46	5,19	6,93	25.792.107,52	4,30	787.013.211,90	3,28
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,40	1,72	2,12	5.106.233,92	0,85	954.396.656,80	0,54
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,76	1,95	8,23	5.132.971,33	0,86	647.176.742,79	0,79
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,99	0,10	6,70	11.213.555,66	1,87	743.224.617,59	1,51
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,11	1,90	8,50	6.517.234,98	1,09	84.690.707,28	7,70
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,92	0,27	0,41	25.130.803,58	4,19	2.099.046.145,62	1,20
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1,34	0,60	0,86	2.017.143,92	0,34	528.117.479,33	0,38
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,76	2,16	5,49	132.397.490,44	22,05		

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	2,83	0,00	-2,36	1.936.881,85	0,32	109.118.479,23	1,78
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,83	0,00	-2,36	1.936.881,85	0,32		
Renda Fixa			7,65	2,89	6,04	403.017.432,43	67,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,32%

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	45,28	9,30	2,74	8.411.376,19	1,40	362.510.754,22	2,32
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,82	9,24	2,75	14.701.055,25	2,45	771.192.657,10	1,91
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,96	9,26	2,71	23.112.431,44	3,85		

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	44,23	8,10	2,65	0,00	0,00	14.717.449,15	0,00
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	44,44	7,91	-3,67	10.641.770,62	1,77	831.394.481,17	1,28
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	48,14	6,93	-5,71	18.295.256,31	3,05	579.185.890,31	3,16
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,29	7,67	-7,92	10.798.544,21	1,80	1.055.279.159,04	1,02
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	42,08	9,43	-5,64	9.547.688,44	1,59	1.838.004.943,11	0,52
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,19	8,61	-1,89	21.785.055,71	3,63	2.180.944.676,59	1,00
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,67	8,38	2,15	4.977.961,74	0,83	970.961.714,32	0,51
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	61,99	4,45	-30,60	2.648.251,57	0,44	520.938.421,78	0,51
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,14	5,25	7,89	8.649.101,01	1,44	2.637.083.961,50	0,33
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	45,07	8,81	5,71	3.731.065,20	0,62	1.024.189.066,60	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	45,01	11,36	3,39	3.237.871,56	0,54	1.182.893.605,71	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	46,37	4,89	-7,45	3.452.685,60	0,58	773.786.718,91	0,45
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,00	9,38	3,06	2.678.399,86	0,45	1.002.240.924,92	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,70	7,61	-3,22	12.634.333,10	2,10	1.388.437.539,18	0,91
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,28	6,43	-4,75	10.107.988,41	1,68	3.601.826.654,02	0,28
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,74	7,98	-21,22	5.568.474,53	0,93	1.462.263.664,51	0,38
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	37,48	7,06	99,98	4.448.672,16	0,74	1.261.336.724,75	0,35
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,85	7,66	-3,86	133.203.120,03	22,19		

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	32,83	3,06	12,58	11.064.848,67	1,84	733.942.233,01	1,51
Sub-total Artigo 8º III			32,83	3,06	12,58	11.064.848,67	1,84		

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	3,24	-0,00	-1,95	848.450,73	0,14	14.745.453,20	5,75
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	484,21	-0,00	-98,82	10.416,92	0,00	61.323.689,95	0,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			112,07	0,00	-47,29	858.867,65	0,14		

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	19,78	0,00	-21,54	1.121.000,00	0,19	140.712.001,53	0,80
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	40,62	0,00	-37,04	585.990,00	0,10	588.319.069,28	0,10
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	41,75	0,46	-27,29	95.734,91	0,02	15.335.692,09	0,62
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			26,77	0,02	-27,64	1.802.724,91	0,30		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,56	7,44	-2,08	170.041.992,70	28,32		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,54%

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	29,11	1,34	55,28	4.389.592,16	0,73	180.450.625,74	2,43
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,55	0,33	72,67	15.122.686,18	2,52	1.276.983.256,79	1,18
Sub-total Artigo 9º A, II			27,87	0,55	68,74	19.512.278,34	3,25		

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	29,61	0,70	54,77	7.755.225,41	1,29	1.987.971.687,17	0,39
Sub-total Artigo 9º A, III			29,61	0,70	54,77	7.755.225,41	1,29		
Investimentos no Exterior			26,85	0,59	66,46	27.267.503,75	4,54		
Total			14,96	4,05	5,10	600.326.928,88	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	268.683.060,14	44,76	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	132.397.490,44	22,05	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.936.881,85	0,32	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	403.017.432,43	67,13				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	23.112.431,44	3,85	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	133.203.120,03	22,19	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	11.064.848,67	1,84	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	858.867,65	0,14	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.802.724,91	0,30	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	170.041.992,70	28,32				35,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	19.512.278,34	3,25	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	7.755.225,41	1,29	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.267.503,75	4,54				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

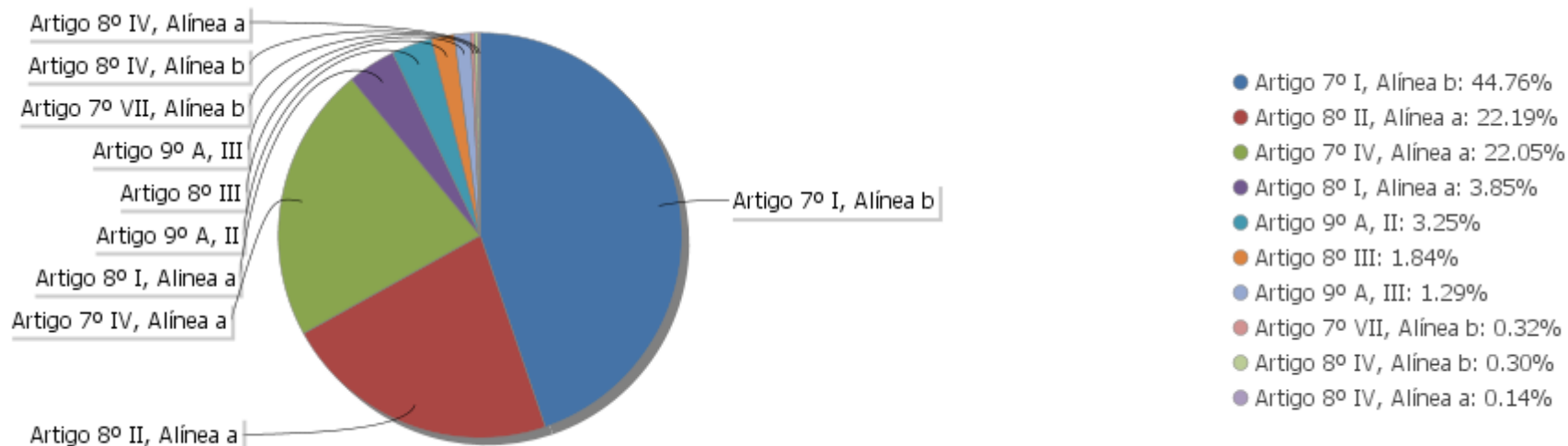
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	3,25 2.071,21	6,46 234,82	5,03 1.084,14	5,85 597,55	6,46 234,82	8.467.317,10	16.689.762,85
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,16 1.373,77	5,49 199,59	3,09 666,49	3,66 373,90	5,49 199,59	2.637.212,22	6.270.087,56
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	-2,36 -85,86	-0,40 -85,75	-1,90 -194,63	-2,36 -85,86	0,00	-47.534,24
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,26 -0,03	2,71 -0,20	25,60 -0,21	24,96 -0,25	2,71 -0,20	1.959.532,11	1.638.748,30
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,66 -1,64	-3,86 -6,78	19,63 -6,17	20,60 -4,61	-3,86 -6,78	9.599.157,57	-2.910.599,99
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,06 -6,23	12,58 9,66	11,36 -14,45	19,61 -5,59	12,58 9,66	328.963,56	1.514.055,66
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -9,30	-47,29 -50,21	-34,59 -60,40	-44,18 -69,38	-47,29 -50,21	0,00	-298.121,59
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,02 -9,27	-27,64 -30,56	-2,03 -27,84	-2,67 -27,87	-27,64 -30,56	441,22	-689.637,09
Artigo 9º A, II % do CDI	0,55 351,98	68,74 3.383,28	3,06 659,19	24,61 2.514,97		107.214,81	5.012.278,34
Artigo 9º A, III % do CDI	0,70 443,59	54,77 1.991,43	1,32 283,49	16,50 1.685,61	54,77 1.991,43	53.626,58	3.111.355,41
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						23.153.465,17	30.290.395,21

Análise de Liquidez

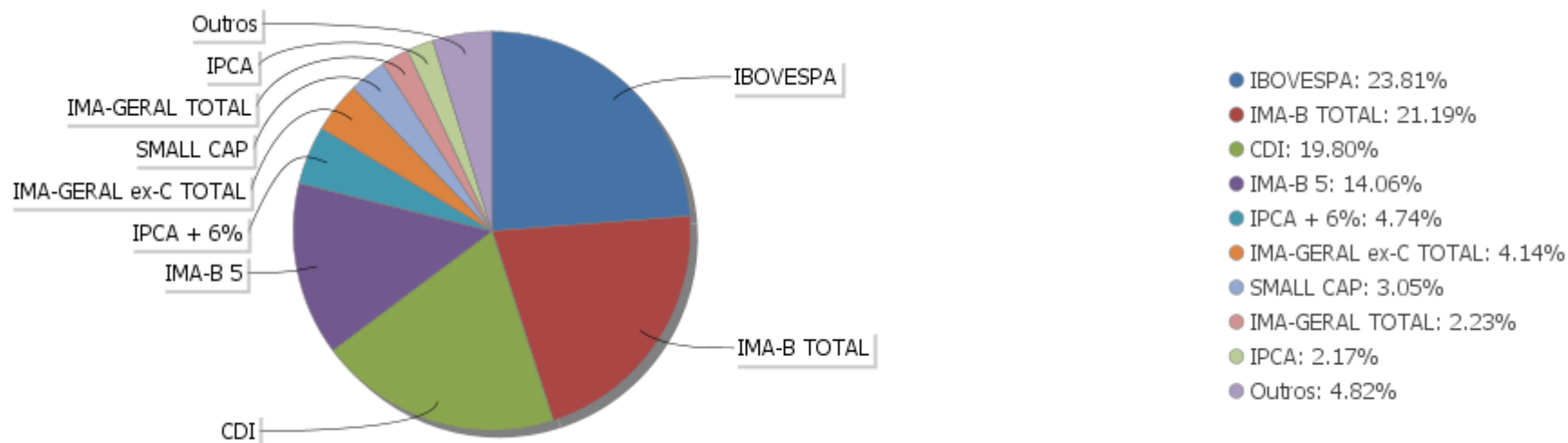
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	558.713.614,51	93,07	558.713.614,51	93,07
de 31 a 364 dias	28.404.426,04	4,73	587.118.040,55	97,80
acima de 365 dias	13.208.888,33	2,20	600.326.928,88	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

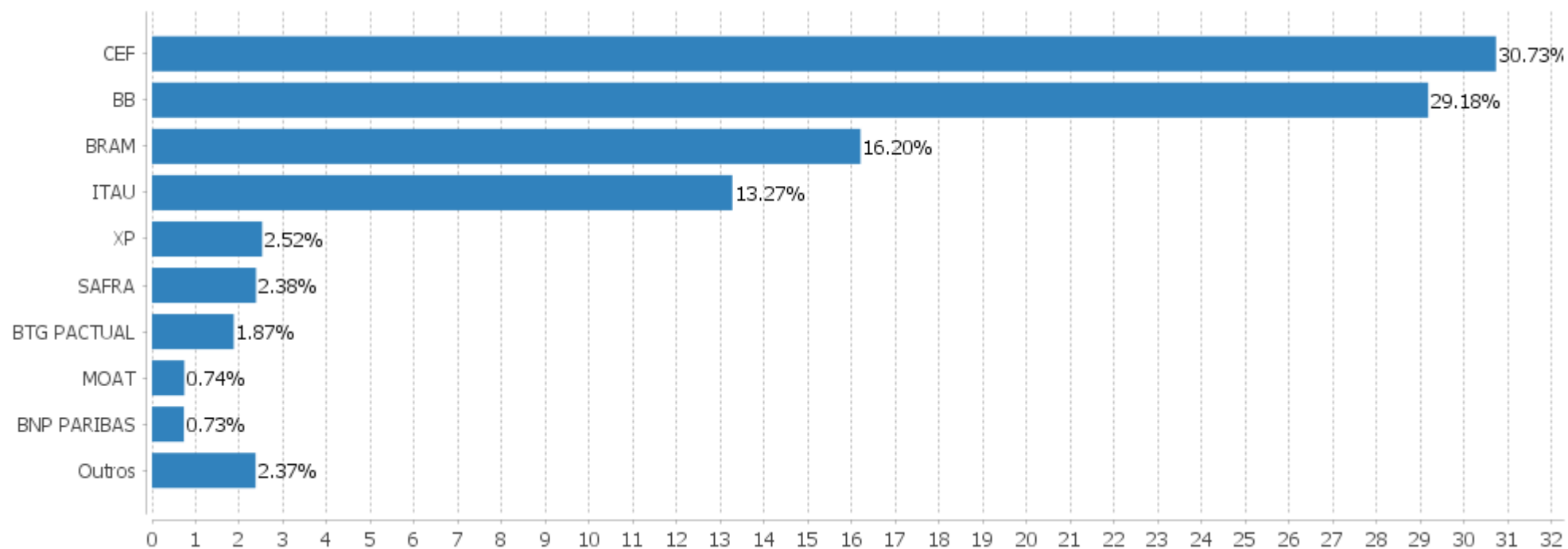


Alocação Por Estratégia



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	4,33	4,05	5,10
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,77	10,54
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02	-1,20	-3,01	-1,67	2,98	2,28	-5,44
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

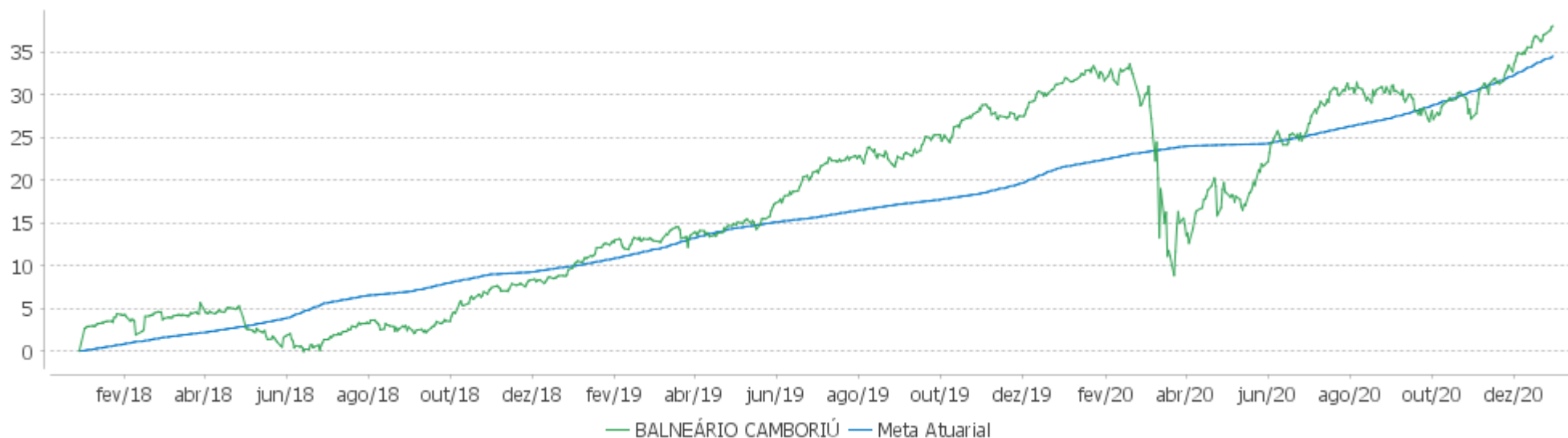
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

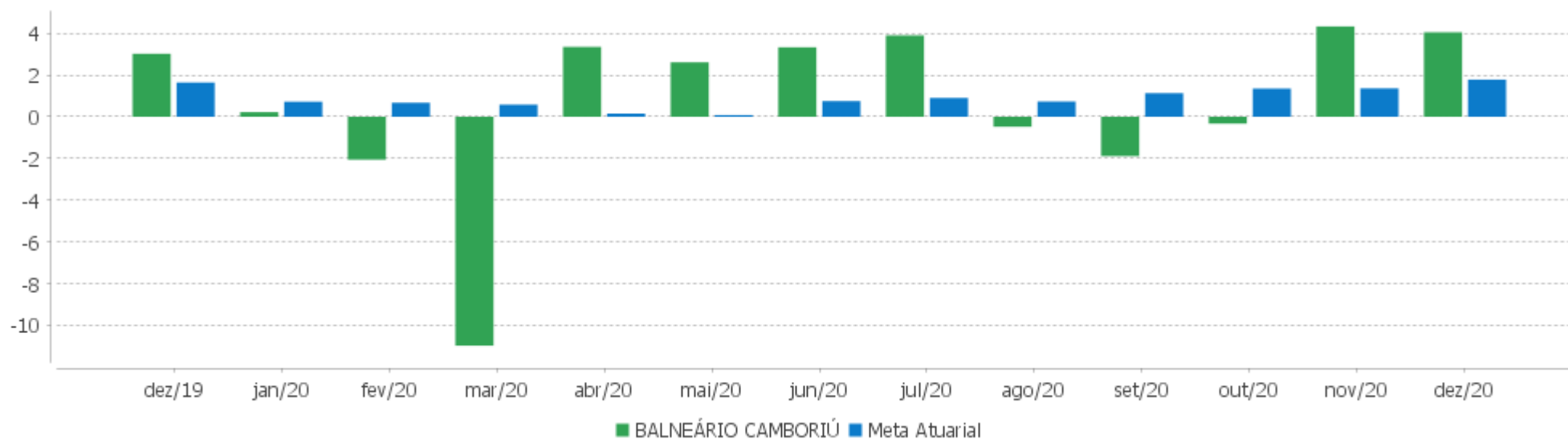
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	55,56	03 meses	8,20	4,53	3,67	6,73
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	44,44	06 meses	9,76	7,39	2,37	7,10
			12 meses	5,10	10,54	-5,44	14,96
			24 meses	25,87	22,24	3,62	11,02
			36 meses	38,07	34,37	3,70	9,60
Maior rentabilidade da Carteira	4,33	2020-11	Desde 29/12/2017	38,07	34,37	3,70	9,60
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 INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,05	7,79 -0,18	3,17 -0,15	4,42 -0,24	7,79 -0,18	21,72 -0,45	33,44 -0,79
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	5,19 3.304,20	6,93 252,12	7,46 1.606,60	8,34 852,44	6,93 252,12	32,64 367,80	51,08 321,95
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,20 127,54	2,38 86,51	0,42 91,05	0,72 73,59	2,38 86,51	8,30 93,50	15,04 94,79
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,36 226,16	2,41 87,55	0,63 135,99	1,02 104,72	2,41 87,55	8,26 93,09	15,01 94,58
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6% p.p.	1,90 0,12	8,50 -2,17	2,84 -1,72	4,34 -3,12	8,50 -2,17	25,44 3,05	49,54 15,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	7,38 -0,06	4,45 -0,98	10,29 -0,16	11,01 -0,27	4,45 -0,98	35,68 -1,76	56,09 -2,52
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI	0,10 63,50	6,70 243,78	0,69 149,24	1,20 122,21	6,70 243,78	18,11 204,09	
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	4,88 3.110,93	7,47 271,71	7,06 1.521,52	7,84 800,96	7,47 271,71	33,77 380,59	50,70 319,56
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	1,95 1.240,72	8,23 299,30	1,68 360,98	1,62 165,88	8,23 299,30	20,79 234,30	34,43 217,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 155,36	2,39 86,96	0,56 121,12	1,01 102,85	2,39 86,96	8,27 93,20	15,13 95,36
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF % do CDI	0,60 381,35	3,43 124,56	0,89 191,31	1,38 140,95	3,43 124,56		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,27 174,79	4,09 148,90	0,76 163,73	1,18 120,67	4,09 148,90		
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,22 138,59	2,47 89,78	0,44 95,55	0,79 80,40	2,47 89,78	8,42 94,92	15,21 95,89
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	2,05 0,05	5,81 0,50	3,01 0,17	3,74 0,37	5,81 0,50	19,46 0,65	31,46 0,73
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,00 0,00	-2,36 -85,86	-0,40 -85,75	-1,90 -194,63	-2,36 -85,86	29,99 337,94	-4,34 -27,33
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,60 -3,19	8,39 2,05	3,19 -3,91	4,69 -3,45	8,39 2,05	24,87 -5,87	38,69 -9,13
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,78	6,00	7,07	8,02	6,00	29,94	46,62

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 TOTAL p.p.	-0,01	-0,34	-0,04	-0,11	-0,34	-0,80	-1,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	7,69	3,26	4,51	7,69	21,53	33,28
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,29	-0,06	-0,15	-0,29	-0,65	-0,95
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,75	7,76	3,25	4,52	7,76	21,64	33,08
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,21	-0,07	-0,14	-0,21	-0,54	-1,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,75	7,72	3,28	4,50	7,72	21,61	33,35
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,25	-0,04	-0,16	-0,25	-0,57	-0,89
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	4,81	6,11	7,00	7,81	6,11	29,91	46,43
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02	-0,23	-0,10	-0,32	-0,23	-0,83	-1,38
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,55	6,86	3,16	4,24	6,86	20,41	42,06
Var. INPC + 6% p.p.	-0,33	-4,79	-1,60	-3,89	-4,79	-3,27	6,52
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,08	4,79	2,82	3,13	4,79	17,71	29,06
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,09	-0,51	-0,01	-0,24	-0,51	-1,10	-1,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,95	6,42	1,92	1,61	6,42	18,85	31,58
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,01	-0,26	-0,05	-0,12	-0,26	-0,66	-0,76
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,60	10,69	4,24	6,89	10,69	21,93	34,45
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,18	0,02	-0,32	-0,57	0,02	-0,46	-0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,76	6,04	7,01	7,96	6,04	29,97	46,16
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,30	-0,09	-0,17	-0,30	-0,77	-1,65
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,50	7,53	7,51	8,08	7,53	33,16	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,71	1,20	0,40	-0,05	1,20	2,41	
BB PREV RF VII	1,15	5,55	2,84	3,85	5,55	16,59	28,01
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,64	-0,78	-4,27	-4,29	-0,78	-14,15	-19,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,35	5,06	3,14	3,25	5,06	18,79	30,56
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,25	0,24	0,34	0,19	0,24	0,74	0,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,29	6,63	2,01	1,92	6,63	24,15	33,86
Var. IPCA p.p.	0,00	2,18	-1,06	-2,43	2,18	15,20	20,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,77	6,08	7,07	7,97	6,08	30,09	46,70
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,26	-0,04	-0,17	-0,26	-0,65	-1,12
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	1,61	10,77	4,26	6,93	10,77	22,10	34,74
Var. INPC + 6% p.p.	-0,28	-0,88	-0,50	-1,20	-0,88	-1,58	-0,80
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,10	4,50	2,82	2,96	4,50	17,43	28,68
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,01	-0,32	0,02	-0,10	-0,32	-0,63	-0,93
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,41	4,99	10,31	10,96	4,99	36,55	57,21
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,03	-0,43	-0,14	-0,32	-0,43	-0,89	-1,40
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	0,46	-27,29	6,37	9,28	-27,29	-31,59	-43,92

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.	-1,73	-17,05	3,68	7,00	-17,05	-53,64	-72,83
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	0,00	-21,54	-1,67	-2,32	-21,54	-1,67	-88,57
Var. IFIX p.p.	-2,19	-11,30	-4,37	-4,59	-11,30	-23,72	-117,48
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	0,00	-37,04	-3,94	-5,03	-37,04	7,15	-5,45
Var. IFIX p.p.	-2,19	-26,80	-6,64	-7,30	-26,80	-14,90	-34,36
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	9,24	2,75	25,53	24,92	2,75	34,60	54,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	-0,17	-0,28	-0,29	-0,17	-0,82	-1,63
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	9,30	2,59	25,72	25,02	2,59	34,71	55,00
Var. IBOVESPA p.p.	0,00	-0,32	-0,09	-0,19	-0,32	-0,71	-0,78
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	6,93	-5,71	22,25	25,83	-5,71	43,77	54,43
Var. SMALL CAP p.p.	-0,59	-5,05	-0,29	0,50	-5,05	-13,39	-15,51
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	11,36	3,39	22,47	20,17	3,39	46,10	95,88
Var. IBOVESPA p.p.	2,06	0,47	-3,34	-5,04	0,47	10,68	40,10
BRADESCO F I A SELECTION	7,91	-3,67	20,64	27,65	-3,67	22,89	54,94
Var. IBOVESPA p.p.	-1,39	-6,58	-5,17	2,44	-6,58	-12,53	-0,84
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	7,98	-21,22	17,88	10,20	-21,22	10,16	38,82
Var. IBOVESPA p.p.	-1,32	-24,14	-7,92	-15,01	-24,14	-25,26	-16,95
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	8,81	5,71	25,38	28,08	5,71	39,89	72,26
Var. IBOVESPA p.p.	-0,49	2,79	-0,43	2,87	2,79	4,47	16,48
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	4,45	-25,49	18,22	6,89	-25,49	24,74	30,84
% do CDI	2.833,48	-926,99	3.926,33	704,51	-926,99	278,77	194,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6,43	-4,75	20,10	22,50	-4,75	38,37	69,47
Var. IBOVESPA p.p.	-2,86	-7,67	-5,71	-2,71	-7,67	2,95	13,69
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,38	3,06	25,04	23,85	3,06	46,41	65,38
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,44	4,06	-0,40	2,55	4,06	2,70	-1,25
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	9,43	5,00	24,21	25,06	5,00	40,65	70,10
Var. IBRX 100 p.p.	0,28	1,50	-1,13	-0,22	1,50	2,59	10,75
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	9,43	-5,64	25,80	21,38	-5,64	16,63	41,32
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,49	-4,64	0,36	0,09	-4,64	-27,08	-25,31
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5,25	7,89	12,40	17,69	7,89	50,22	81,72
Var. IBOVESPA p.p.	-4,05	4,97	-13,40	-7,51	4,97	14,80	25,94
FIA CAIXA CONSUMO	4,89	-0,56	10,55	12,12	-0,56	54,55	35,15
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,10	-1,38	-0,55	-1,02	-1,38	-1,96	-6,37
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	7,06	99,98	21,87	21,99			
Var. IBOVESPA p.p.	-2,24	25,80	-3,94	-3,22			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7,61	-3,22	21,54	23,21	-3,22	49,76	57,26

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.	-1,69	-6,14	-4,27	-2,00	-6,14	14,34	1,49
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8,38	2,15	21,64	22,51	2,15	37,95	60,16
Var. IBOVESPA p.p.	-0,92	-0,76	-4,16	-2,70	-0,76	2,53	4,38
BB AÇÕES DIVIDENDOS	7,67	-7,92	20,56	18,49	-7,92	18,36	38,54
Var. IBOVESPA p.p.	-1,62	-10,84	-5,25	-6,72	-10,84	-17,06	-17,23
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	8,61	-1,89	14,89	16,22	-1,89	41,75	75,20
Var. IBOVESPA p.p.	-0,68	-4,81	-10,92	-8,99	-4,81	6,33	19,43
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	0,00	-1,95	0,02	0,13	-1,95	13,12	147,89
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,78	-12,62	-4,54	-7,33	-12,62	-9,27	113,36
FIP CAIXA CYRELA	0,00	-98,82	-98,27	-98,74	-98,82	-98,91	
Var. IBOVESPA p.p.	-9,30	-101,74	-124,08	-123,94	-101,74	-134,33	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3,06	12,58	11,36	19,61	12,58	48,59	44,75
Var. IBOVESPA p.p.	-6,23	9,66	-14,45	-5,59	9,66	13,17	-11,03
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,34	75,67	3,66	18,34	75,67	140,57	
Var. IBOVESPA p.p.	-7,95	72,75	-22,14	-6,87	72,75	105,15	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,33	91,59	2,86	26,15	91,59		
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,46	80,92	-1,70	18,69	80,92		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,70	54,77	1,32	16,50	54,77	108,10	129,29
Var. IBOVESPA p.p.	-8,60	51,85	-24,49	-8,71	51,85	72,68	73,51
BALNEÁRIO CAMBORIÚ	4,05	5,10	8,20	9,76	5,10	25,87	38,07
Var. IPCA + 6% p.p.	2,27	-5,57	3,64	2,30	-5,57	3,48	3,54
CDI	0,16	2,75	0,46	0,98	2,75	8,87	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,89	11,65	4,76	8,13	11,65	23,68	35,54
IPCA + 6%	1,78	10,67	4,56	7,46	10,67	22,39	34,53

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	0,30	3,83	0,69	1,20	3,83	10,85	18,58
IRF-M 1+	3,03	8,43	2,88	2,27	8,43	23,87	39,07
IRF-M TOTAL	1,94	6,68	1,97	1,73	6,68	19,51	32,34
IMA-B 5	1,77	7,98	3,32	4,66	7,98	22,18	34,23
IMA-B 5+	7,43	5,42	10,45	11,28	5,42	37,44	58,61
IMA-B TOTAL	4,78	6,34	7,11	8,14	6,34	30,74	47,81
IMA-C TOTAL	-1,17	22,00	3,58	13,52	22,00	45,68	72,46
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,09	4,82	2,80	3,06	4,82	18,05	29,62
IMA-GERAL TOTAL	2,00	5,31	2,83	3,38	5,31	18,81	30,73
IDKA 2	1,67	8,56	2,99	5,04	8,56	21,39	33,23
IDKA 20	11,28	2,13	15,82	16,49	2,13	47,33	77,40
CDI	0,16	2,75	0,46	0,98	2,75	8,87	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON	5,00	0,81	11,11	13,14	0,81	56,51	41,53
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,29	4,45	3,07	4,35	4,45	8,95	13,03
INPC	1,39	5,38	3,27	5,00	5,38	10,10	13,88
IGPM	0,91	23,08	7,59	17,91	23,08	32,08	42,03
SELIC	0,16	2,75	0,46	0,98	2,75	8,87	15,87
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

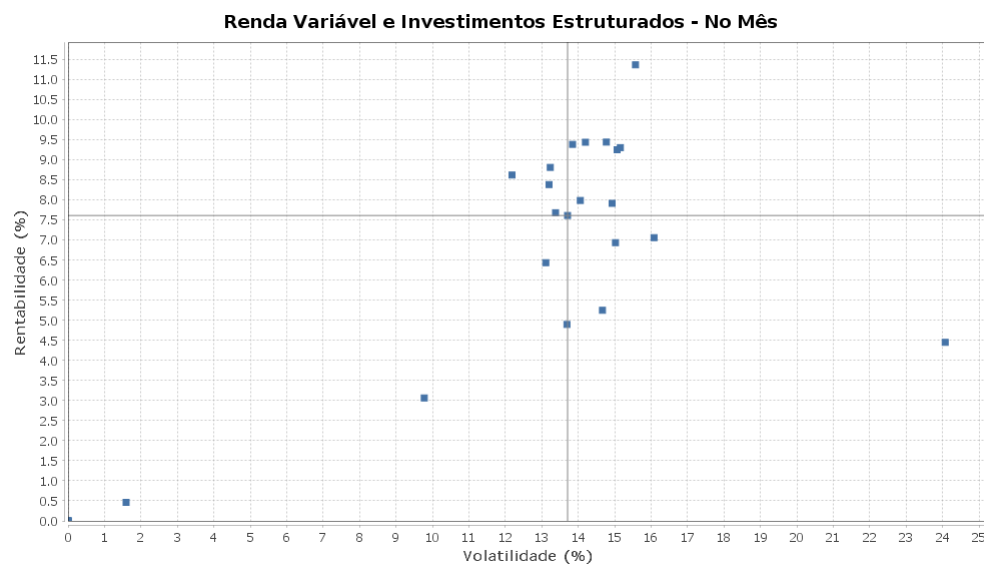
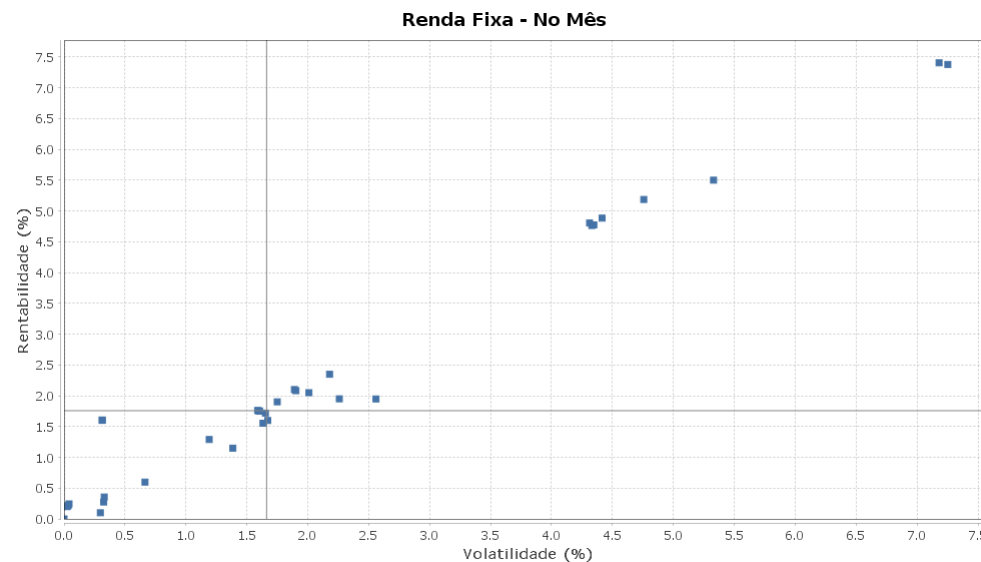
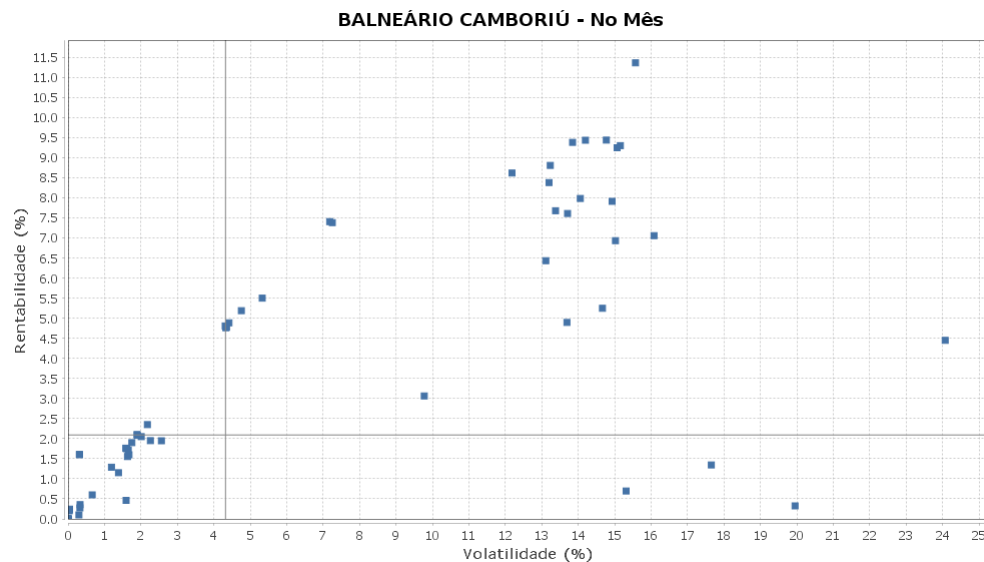
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
514	01/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	197.828,28	53.088,31068000	3,7264000000
515	01/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	7.613,72	2.043,18377500	3,7264000000
527	01/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.102.704,09	295.916,72632100	3,7264000000
528	03/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	73.341,87	0,00	19.676,20404300	3,7274400000
516	04/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	736,00	197,42664000	3,7279670000
517	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	18.400,00	4.930,40886300	3,7319420000
529	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	116.911,30	31.327,20168500	3,7319420000
530	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	129.560,56	0,00	34.712,90175100	3,7323460000
518	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	86.000,00	23.033,89637000	3,7336280000
531	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	100,00	26,78358400	3,7336280000
519	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	16.000,00	4.284,96178100	3,7339890000
532	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.183.882,39	584.865,78135300	3,7339890000
520	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.839,83	2.367,02568100	3,7345730000
521	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.000,00	1.338,84117600	3,7345730000
533	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	15.000,00	4.016,52346000	3,7345730000
534	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	513.000,00	137.365,10182500	3,7345730000
535	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	79.288,40	0,00	21.227,10055800	3,7352440000
536	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.549.073,64	950.158,44846200	3,7352440000
513	17/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	2.665.830,97	0,00	54.668,99251000	48,7631260000
522	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	22.000,00	5.889,10643800	3,7357110000
523	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	22.000,00	5.889,10644000	3,7357110000
524	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.676,86656200	3,7357110000
537	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.668.811,69	0,00	2.855.898,56656400	3,7357110000
508	18/12/2020	BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	0,00	2.029.279,25	77.006,27968890	26,3521268000
509	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.000,00	622,86901200	3,2109480000
512	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	12.500,00	5.337,73506600	2,3418170000
538	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.100.000,00	294.418,52100000	3,7361780000
539	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	50.000,00	13.382,66002200	3,7361780000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
540	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	250.000,00	66.913,30023200	3,7361780000
510	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	195.000,00	60.718,13619100	3,2115610000
511	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	80.000,00	24.910,00459000	3,2115610000
525	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.269,90	0,00	1.945,50686100	3,7367640000
541	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	274.262,83	0,00	73.395,81252600	3,7367640000
506	22/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.190,96	0,00	26.600,49990800	2,3003687980
542	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.500,00	0,00	6.555,24007100	3,7374680000
507	23/12/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.029.279,25	0,00	167.232,70043950	12,1344644000
543	24/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	117.578,41	31.456,95179900	3,7377560000
544	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	138.032,40	0,00	36.925,27463400	3,7381550000
526	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	615,84	0,00	164,72097400	3,7386860000
545	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.563,66	0,00	13.524,44682400	3,7386860000
546	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	947.787,87	0,00	253.508,28339100	3,7386860000
548	29/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	89,55	38,91198700	2,3013474210
504	29/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	179,10	0,00	77,82397300	2,3013474210
547	30/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	88.473,88	0,00	23.661,62182100	3,7391300000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 21.071.460,68

Value-At-Risk: 3,51%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,00	0,04	0,00	0,00	0,00	1.936.881,85	0,32
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	0,00	0,04	-0,00	0,00	0,00	1.121.000,00	0,19
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	0,00	0,04	0,00	0,00	0,00	585.990,00	0,10
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	0,00	0,00	848.450,73	0,14
FIP CAIXA CYRELA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,00	18,61	0,00	0,00	0,00	10.416,92	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,10	0,00	1,65	0,20	4.348.497,97	0,72
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,08	0,00	1,80	0,22	2.668.266,09	0,44
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,09	0,00	2,09	0,24	8.372.942,32	1,39
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,30	0,28	-0,00	-0,19	0,10	11.213.555,66	1,87
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,19	0,00	4,61	1,60	5.946.092,00	0,99
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,19	0,00	4,63	1,61	2.961.288,00	0,49
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,33	0,24	0,00	0,36	0,27	25.130.803,58	4,19
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,33	0,13	0,00	0,60	0,36	16.267.975,43	2,71
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,66	0,32	0,00	0,66	0,60	2.017.143,92	0,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,19	1,24	0,02	0,95	1,29	13.032.917,99	2,17
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,38	1,10	0,00	0,72	1,15	283.658,95	0,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,59	1,06	0,03	1,01	1,76	25.371.217,43	4,23
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,59	1,16	-0,00	0,19	0,46	95.734,91	0,02
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,05	0,00	1,00	1,75	3.153.295,88	0,53
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,05	0,06	1,00	1,75	50.790.358,16	8,46
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,11	0,00	0,86	1,55	887.064,46	0,15
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,65	1,10	0,01	0,95	1,72	5.106.233,92	0,85
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,67	1,12	0,00	0,86	1,60	3.296.323,42	0,55
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	1,75	1,44	0,01	1,00	1,90	6.517.234,98	1,09
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,89	1,07	0,01	1,03	2,10	4.562.075,21	0,76
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,90	1,08	0,01	1,01	2,08	9.869.036,47	1,64
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,01	1,16	0,01	0,94	2,05	3.512.452,94	0,59
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,18	1,35	0,03	1,01	2,35	20.285.115,01	3,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,26	1,37	0,00	0,79	1,95	34.254,20	0,01
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,56	1,41	0,01	0,70	1,95	5.132.971,33	0,86
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,31	2,58	0,01	1,08	4,81	2.549.413,13	0,42
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,33	2,62	0,01	1,06	4,76	3.499.203,80	0,58
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,34	2,64	0,15	1,06	4,77	46.508.798,65	7,75
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,35	2,64	0,23	1,06	4,78	69.825.683,76	11,63
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,42	2,80	0,05	1,07	4,88	13.363.645,63	2,23
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,76	2,85	0,09	1,06	5,19	25.792.107,52	4,30
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	3,23	0,00	1,00	5,50	1.222.151,65	0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,18	4,61	0,03	1,01	7,41	4.605.111,97	0,77
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,25	4,57	0,02	1,00	7,38	2.953.659,15	0,49
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,77	8,13	0,09	0,30	3,06	11.064.848,67	1,84
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	12,18	10,40	0,35	0,69	8,61	21.785.055,71	3,63
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	13,11	10,32	0,16	0,48	6,43	10.107.988,41	1,68
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	13,20	9,75	0,08	0,62	8,38	4.977.961,74	0,83
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,23	10,79	0,06	0,65	8,81	3.731.065,20	0,62
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	13,38	9,93	0,17	0,56	7,67	10.798.544,21	1,80
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	13,69	9,92	0,05	0,35	4,89	3.452.685,60	0,58
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	13,71	10,59	0,21	0,54	7,61	12.634.333,10	2,10
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,85	9,76	0,04	0,67	9,38	2.678.399,86	0,45
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	14,06	11,67	0,10	0,56	7,98	5.568.474,53	0,93
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	14,20	NaN	0,00	0,65	9,43	0,00	0,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,67	10,20	0,13	0,35	5,25	8.649.101,01	1,44
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	14,77	11,27	0,16	0,63	9,43	9.547.688,44	1,59
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	14,93	11,00	0,17	0,52	7,91	10.641.770,62	1,77
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	15,02	11,11	0,31	0,45	6,93	18.295.256,31	3,05
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	15,07	10,76	0,25	0,60	9,24	14.701.055,25	2,45
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	15,16	10,83	0,14	0,60	9,30	8.411.376,19	1,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	15,32	12,72	0,03	0,04	0,70	7.755.225,41	1,29
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,57	10,67	0,05	0,72	11,36	3.237.871,56	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,08	11,85	0,08	0,43	7,06	4.448.672,16	0,74
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	17,65	12,04	0,02	0,07	1,34	4.389.592,16	0,73
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,95	12,37	-0,01	0,01	0,33	15.122.686,18	2,52
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	24,07	17,77	0,06	0,18	4,45	2.648.251,57	0,44