



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
FEVEREIRO 2021



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 26.02.2021.

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 68,39%

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	12,36	-1,51	-2,38	2.490.321,91	0,42	255.345.496,07	0,98
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,06	-0,61	-0,53	3.138.389,87	0,53	1.602.588.762,05	0,20
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,80	-1,53	-2,40	3.417.556,23	0,58	398.123.526,61	0,86
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-1,53	-2,38	45.427.131,04	7,66	7.633.267.120,04	0,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-1,54	-2,40	68.192.538,18	11,49	6.061.546.612,54	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,58	-0,83	-1,28	9.744.774,39	1,64	1.174.293.200,64	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	-0,62	-0,54	25.249.384,93	4,26	13.590.487.322,92	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-2,32	-3,97	4.424.939,88	0,75	1.462.684.676,28	0,30
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,47	-0,84	-1,28	4.504.659,92	0,76	540.207.422,01	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,16	-1,15	-1,92	33.602,12	0,01	2.086.612.425,47	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,06	-0,61	-0,52	50.553.658,04	8,52	5.161.165.829,74	0,98
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,13	-0,49	-0,36	3.204.460,51	0,54	286.951.715,22	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,48	-0,01	0,27	277.087,28	0,05	240.033.347,68	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	19.994.479,35	3,37	9.434.126.715,63	0,21
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	12.974.127,90	2,19	15.107.095.289,30	0,09
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,82	-1,86	-3,50	1.180.099,90	0,20	1.669.878.087,92	0,07
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,25	-0,45	-0,30	861.900,87	0,15	571.461.055,56	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,46	0,79	2,13	5.910.240,00	1,00	198.765.217,32	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,46	0,79	2,14	2.941.618,00	0,50	225.006.126,71	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,49	-1,05	-1,47	264.520.970,32	44,59		

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	0,09	0,24	12.726.021,65	2,15	6.887.930.929,76	0,18

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	14,65	-1,63	-2,67	13.014.235,36	2,19	628.108.577,64	2,07
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,18	0,09	0,26	974.035,14	0,16	20.416.973.729,73	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,08	0,24	16.093.481,21	2,71	5.566.337.148,97	0,29
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	6,05	-0,74	-0,98	3.478.835,18	0,59	756.200.744,61	0,46
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,22	0,10	0,26	10.763.373,25	1,81	2.967.792.040,55	0,36
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	20,07	-2,21	-3,84	2.842.137,88	0,48	214.647.835,49	1,32
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,58	-1,77	-2,85	25.070.514,91	4,23	771.241.393,86	3,25
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,47	-0,79	-0,81	5.067.729,37	0,85	1.027.850.150,22	0,49
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,88	-1,24	-2,07	5.027.038,61	0,85	568.971.296,52	0,88
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,95	-0,12	-0,41	11.169.035,81	1,88	732.071.232,34	1,53
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,16	-0,59	-0,57	6.483.787,50	1,09	84.256.061,30	7,70
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,91	-0,15	-0,27	25.067.695,93	4,23	2.130.884.392,06	1,18
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1,36	-0,06	-0,34	1.511.121,05	0,25	525.620.232,39	0,29
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,82	-0,66	-1,07	139.289.042,85	23,48		

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	2,85	-0,09	0,61	1.945.626,09	0,33	109.777.639,98	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,85	-0,09	0,61	1.945.626,09	0,33		
Renda Fixa			7,71	-0,91	-1,32	405.755.639,26	68,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,00%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA IBOVESPA PLUS	45,19		-7,59	0,00	0,00	323.004.119,73	0,00
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,74	-4,38	-7,56	14.078.512,70	2,37	757.221.929,79	1,86
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,88	-4,37	-7,55	14.078.512,70	2,37		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	44,14	-3,24	-5,64	10.040.609,73	1,69	748.567.197,38	1,34
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	47,75	-2,23	-6,83	17.044.750,51	2,87	502.242.696,38	3,39
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,12	-4,74	-8,92	9.835.097,26	1,66	942.945.774,49	1,04
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	42,12	-3,89	-8,01	8.782.799,29	1,48	1.611.560.743,75	0,54
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,71	-0,77	-3,43	21.037.395,98	3,55	2.091.910.274,82	1,01
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,48	-3,85	-6,10	4.673.865,26	0,79	941.584.140,74	0,50
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	62,29	-10,15	-16,50	2.211.043,15	0,37	416.613.113,87	0,53
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,02	-2,53	-3,13	8.377.578,50	1,41	2.741.202.425,63	0,31
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,72	-0,97	-2,83	3.625.068,23	0,61	967.923.119,26	0,37
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	44,80	-3,23	-7,34	2.999.951,65	0,51	1.084.705.821,24	0,28
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	46,18	-5,36	-6,66	3.222.458,70	0,54	631.793.991,04	0,51
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,87	-4,31	-7,91	2.466.294,64	0,42	927.907.033,94	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,25	-1,99	-5,40	11.950.855,95	2,01	1.156.878.405,76	1,03
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,65	-3,68	-5,78	190.150,93	0,03	2.112.204.537,83	0,01
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,99	0,47	-1,00	9.994.242,63	1,68	3.416.632.575,89	0,29
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,67	-4,30	-7,08	5.173.667,51	0,87	1.154.784.976,21	0,45
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	36,08	-5,96	-11,84	3.921.452,13	0,66	1.095.254.662,63	0,36
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,54	-2,71	-5,88	125.547.282,05	21,16		

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	32,13	2,59	2,41	11.824.676,93	1,99	825.903.419,31	1,43
Sub-total Artigo 8º III			32,13	2,59	2,41	11.824.676,93	1,99		

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	25,64	-0,03	0,45	1.097.566,99	0,19	18.994.857,33	5,78
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	485,18	-100,00	-100,00	0,00	0,00	508.639,17	0,00
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			114,97	-0,82	-0,41	1.097.566,99	0,19		

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	16,69	-0,27	-0,80	1.114.920,00	0,19	146.231.801,97	0,76
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	31,97	-5,61	-4,58	546.625,26	0,09	730.601.750,67	0,07
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	39,25	-0,39	2,37	66.648,72	0,01	11.507.603,06	0,58
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			20,47	-2,03	-1,91	1.728.193,98	0,29		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,26	-2,49	-5,42	154.276.232,65	26,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,60%

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	29,82	3,51	7,62	5.239.048,84	0,88	251.507.662,02	2,08
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,46	4,75	5,03	1.553.521,78	0,26	584.768.098,73	0,27
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,01	4,42	8,91	16.948.720,71	2,86	1.706.818.937,80	0,99
Sub-total Artigo 9º A, II			27,04	4,31	8,64	23.741.291,33	4,00		

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	29,47	3,55	9,54	9.497.377,75	1,60	2.403.594.907,13	0,40
Sub-total Artigo 9º A, III			29,47	3,55	9,54	9.497.377,75	1,60		
Investimentos no Exterior			26,67	4,15	8,98	33.238.669,08	5,60		
Total			14,92	-1,04	-1,94	593.270.540,99	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	264.520.970,32	44,59	0,00	52,11	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	139.289.042,85	23,48	0,00	11,45	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.945.626,09	0,33	0,00	0,35	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	405.755.639,26	68,39					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	14.078.512,70	2,37	0,00	2,00	30,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	125.547.282,05	21,16	0,00	19,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	11.824.676,93	1,99	0,00	4,55	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.097.566,99	0,19	0,00	0,20	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.728.193,98	0,29	0,00	0,34	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	154.276.232,65	26,00					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	23.741.291,33	4,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.497.377,75	1,60	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	33.238.669,08	5,60					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	-1,05 -779,37	-1,47 -516,49	1,79 398,61	2,61 285,20	3,96 167,54	-2.801.854,03	-3.941.517,43
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,66 -494,28	-1,07 -375,98	1,10 243,83	1,31 142,80	3,47 146,72	-923.197,36	-1.463.953,95
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,09 -69,20	0,61 214,55	0,45 100,52	-0,18 -19,49	-1,08 -45,75	-1.813,08	11.792,31
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,37 0,01	-7,55 -0,00	1,01 -0,04	10,60 -0,13	5,35 -0,28	-398.135,78	-1.167.586,20
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,71 1,66	-5,88 1,67	1,32 0,27	6,92 -3,82	-0,94 -6,57	-3.501.935,17	-7.833.863,04
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,59 6,97	2,41 9,96	5,56 4,51	8,58 -2,15	24,11 18,48	278.856,42	259.412,96
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,82 3,55	-0,41 7,13	27,79 26,74	-16,48 -27,21	-34,73 -40,36	-9.101,39	-4.550,04
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,03 2,35	-1,91 5,63	-4,11 -5,15	-5,98 -16,71	-14,81 -20,43	-35.769,41	-33.693,43
Artigo 9º A, II % do CDI	4,31 3.201,35	8,64 3.039,02	9,16 2.038,84	14,17 1.548,51		916.181,87	1.743.404,04
Artigo 9º A, III % do CDI	3,55 2.636,28	9,54 3.356,14	10,30 2.292,95	8,76 957,42	68,74 2.909,74	293.576,99	742.363,62
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						-6.183.190,94	-11.688.191,16

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.178.901,64	0,00	0,00	0,00	19.994.479,35	-184.422,29	-296.500,59
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.542.643,73	0,00	0,00	0,00	4.504.659,92	-37.983,81	-58.417,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	50.866.250,03	0,00	0,00	0,00	50.553.658,04	-312.591,99	-263.577,62
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	46.134.299,86	0,00	0,00	0,00	45.427.131,04	-707.168,82	-1.109.127,29
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.529.932,79	0,00	0,00	0,00	4.424.939,88	-104.992,91	-183.147,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	888.904,42	0,00	-23.204,49	0,00	861.900,87	-3.799,06	-2.474,79
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	3.302.675,67	0,00	-82.576,70	0,00	3.204.460,51	-15.638,46	-11.210,62
BB PREV RF VII	284.631,89	0,00	-7.540,65	0,00	277.087,28	-3,96	810,02
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	2.528.486,30	0,00	0,00	0,00	2.490.321,91	-38.164,39	-60.701,89
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.030.196,00	0,00	0,00	166.812,08	5.910.240,00	46.856,08	126.168,08
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	3.003.352,00	0,00	0,00	85.239,22	2.941.618,00	23.505,22	63.173,22
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.826.349,13	0,00	0,00	0,00	9.744.774,39	-81.574,74	-126.683,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.406.841,01	0,00	0,00	0,00	25.249.384,93	-157.456,08	-136.322,51
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	69.259.513,01	0,00	0,00	0,00	68.192.538,18	-1.066.974,83	-1.676.572,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.994,10	0,00	0,00	0,00	33.602,12	-391,98	-656,15
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	13.040.313,02	0,00	0,00	0,00	12.974.127,90	-66.185,12	-62.887,92
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.470.759,68	0,00	0,00	0,00	3.417.556,23	-53.203,45	-83.890,70
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.157.694,34	0,00	0,00	0,00	3.138.389,87	-19.304,47	-16.732,70
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.202.458,87	0,00	0,00	0,00	1.180.099,90	-22.358,97	-42.765,29
					264.520.970,32	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6.522.298,31	0,00	0,00	0,00	6.483.787,50	-38.510,81	-37.287,65
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.420.255,62	2.334.608,40	0,00	0,00	10.763.373,25	8.509,23	22.357,92
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5.090.154,82	0,00	0,00	0,00	5.027.038,61	-63.116,21	-106.470,99
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	4.355.463,66	8.365.847,51	0,00	0,00	12.726.021,65	4.710,48	11.307,01
BRADESCO H FI RF NILO	25.521.244,96	0,00	0,00	0,00	25.070.514,91	-450.730,05	-736.657,08
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.108.139,12	0,00	0,00	0,00	5.067.729,37	-40.409,75	-41.438,31
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3.504.689,25	0,00	0,00	0,00	3.478.835,18	-25.854,07	-34.569,76
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	2.906.317,63	0,00	0,00	0,00	2.842.137,88	-64.179,75	-113.561,35
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.121.806,44	7.765.939,36	-8.806.991,02	0,00	16.093.481,21	12.726,43	41.854,01
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	11.182.727,30	0,00	0,00	0,00	11.169.035,81	-13.691,49	-45.456,53
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.572.725,52	0,00	-600.000,00	0,00	974.035,14	1.309,62	5.517,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	25.105.537,66	0,00	0,00	0,00	25.067.695,93	-37.841,73	-66.867,06
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	13.229.706,99	0,00	0,00	0,00	13.014.235,36	-215.471,63	-356.423,24
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	2.011.768,68	0,00	-500.000,00	0,00	1.511.121,05	-647,63	-6.258,88
					139.289.042,85	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	1.947.439,17	0,00	0,00	0,00	1.945.626,09	-1.813,08	11.792,31
					1.945.626,09	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	8.129.862,68	0,00	-8.365.847,51	0,00	0,00	235.984,83	-45.338,06
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	14.212.633,31	500.000,00	0,00	0,00	14.078.512,70	-634.120,61	-1.122.248,14
					14.078.512,70	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	3.660.685,36	0,00	0,00	0,00	3.625.068,23	-35.617,13	-105.726,41
BB AÇÕES DIVIDENDOS	10.324.026,67	0,00	0,00	0,00	9.835.097,26	-488.929,41	-962.675,23
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	17.433.144,97	0,00	0,00	0,00	17.044.750,51	-388.394,46	-1.249.042,99
BRADESCO F I A SELECTION	10.377.163,29	0,00	0,00	0,00	10.040.609,73	-336.553,56	-600.511,74
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21.201.537,64	0,00	0,00	0,00	21.037.395,98	-164.141,66	-746.342,80
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	9.138.324,41	0,00	0,00	0,00	8.782.799,29	-355.525,12	-764.316,80
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	8.594.849,72	0,00	0,00	0,00	8.377.578,50	-217.271,22	-270.506,96
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	2.460.797,19	0,00	0,00	0,00	2.211.043,15	-249.754,04	-436.999,74
FIA CAIXA CONSUMO	3.405.008,09	0,00	0,00	0,00	3.222.458,70	-182.549,39	-230.007,09
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	12.194.059,88	0,00	0,00	0,00	11.950.855,95	-243.203,93	-682.723,61
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	2.577.455,75	0,00	0,00	0,00	2.466.294,64	-111.161,11	-211.933,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9.947.161,32	0,00	0,00	0,00	9.994.242,63	47.081,31	-100.708,80
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.861.131,85	0,00	0,00	0,00	4.673.865,26	-187.266,59	-303.557,45
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	5.406.098,63	0,00	0,00	0,00	5.173.667,51	-232.431,12	-394.243,49
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	97.825,68	100.000,00	0,00	0,00	190.150,93	-7.674,75	-9.849,07
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	4.169.843,91	0,00	0,00	0,00	3.921.452,13	-248.391,78	-526.907,96
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	3.100.102,86	0,00	0,00	0,00	2.999.951,65	-100.151,21	-237.809,84
					125.547.282,05	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	11.045.820,51	500.000,00	0,00	0,00	11.824.676,93	278.856,42	259.412,96
					11.824.676,93	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP CAIXA CYRELA	8.780,02	0,00	0,00	0,00	0,00	-8.780,02	-9.501,12
GÂVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	1.097.888,36	0,00	0,00	0,00	1.097.566,99	-321,37	4.951,08
					1.097.566,99	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	1.117.960,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.114.920,00	-3.040,00	-8.968,00
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	579.096,00	0,00	0,00	0,00	0,00	546.625,26	-32.470,74	-26.266,14
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	66.927,50	0,00	0,00	0,00	20,11	66.648,72	-258,67	1.540,71
						1.728.193,98	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.572.644,28	500.000,00	0,00	0,00	5.239.048,84	166.404,56	341.306,16
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.002.649,73	500.000,00	0,00	0,00	1.553.521,78	50.872,05	53.521,78
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.749.815,45	500.000,00	0,00	0,00	16.948.720,71	698.905,26	1.348.576,10
					23.741.291,33	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.203.800,76	1.000.000,00	0,00	0,00	9.497.377,75	293.576,99	742.363,62
					9.497.377,75	0,00	0,00

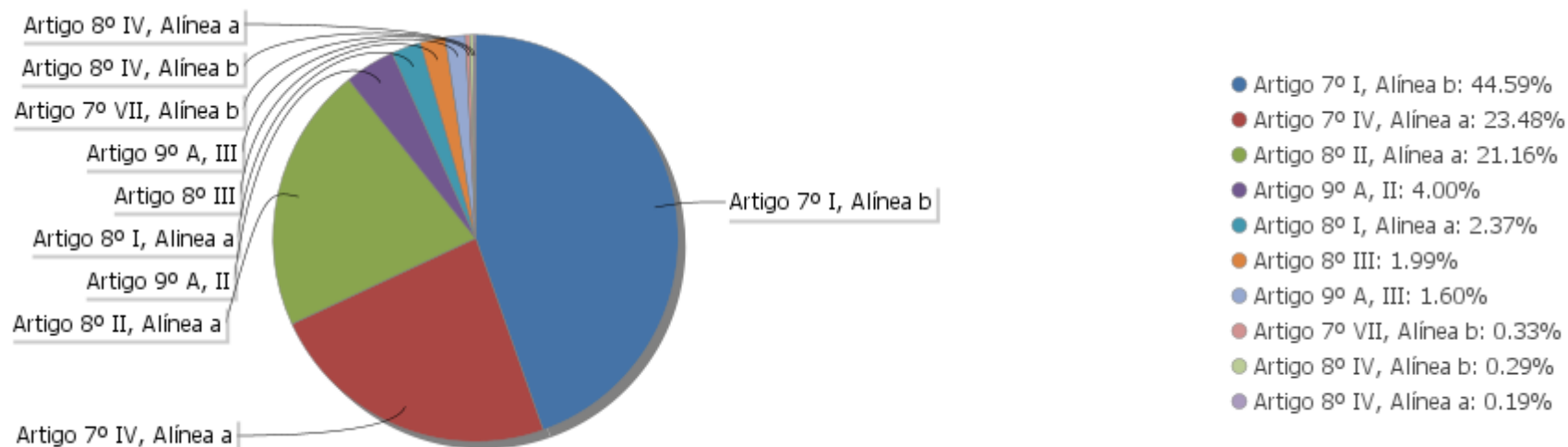
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

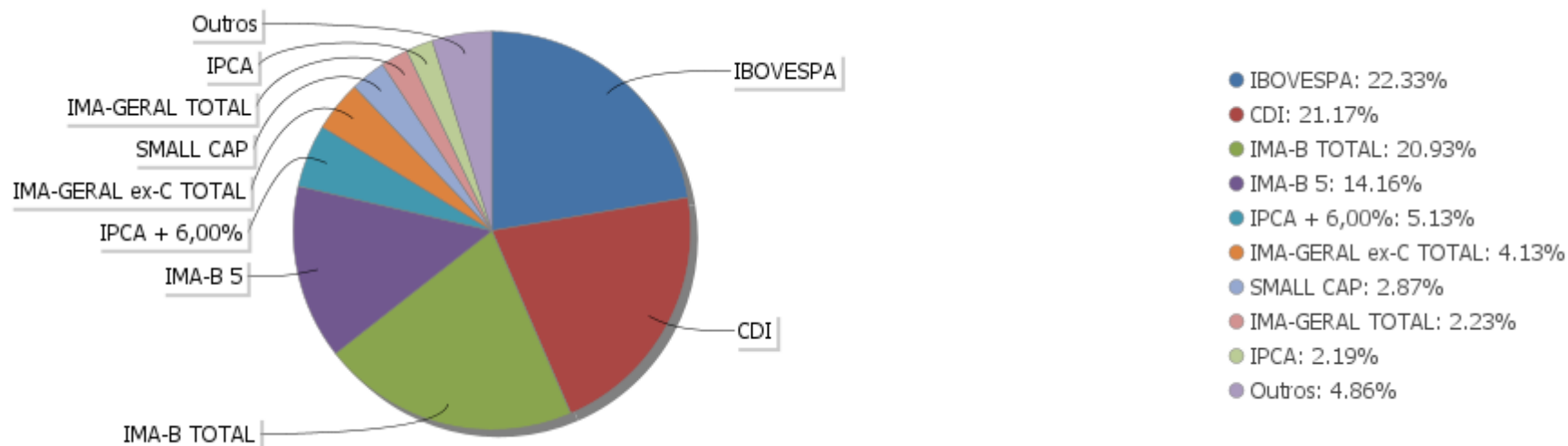
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	544.205.087,16	91,73	544.205.087,16	91,73
de 31 a 365 dias	32.826.954,09	5,53	577.032.041,25	97,26
acima de 365 dias	16.238.499,74	2,74	593.270.540,99	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

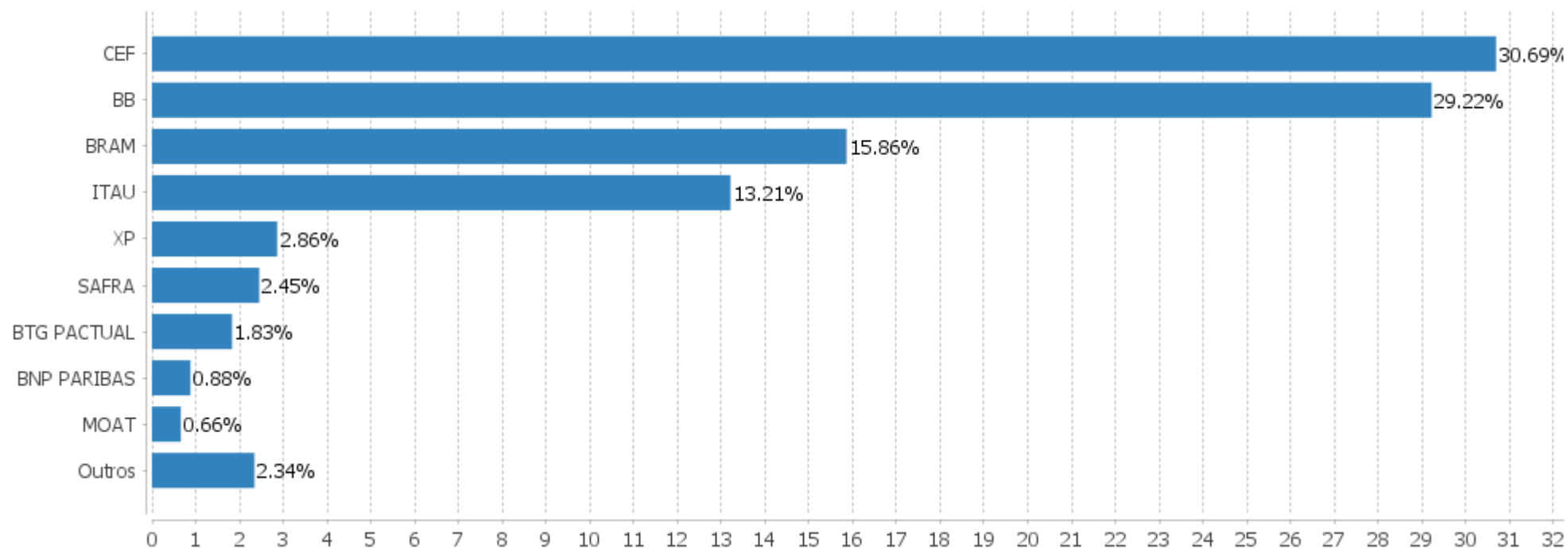


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,91	-1,04											-1,94
IPCA + 5,42%	0,67	1,24											1,92
p.p. indexador	-1,59	-2,28											-3,86
2020	0,22	-2,06	-10,98	3,35	2,61	3,33	3,90	-0,48	-1,89	-0,33	4,33	4,11	5,16
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	1,86	10,63
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	2,26	-5,47
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 + 6,00%	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 + 6,00%	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

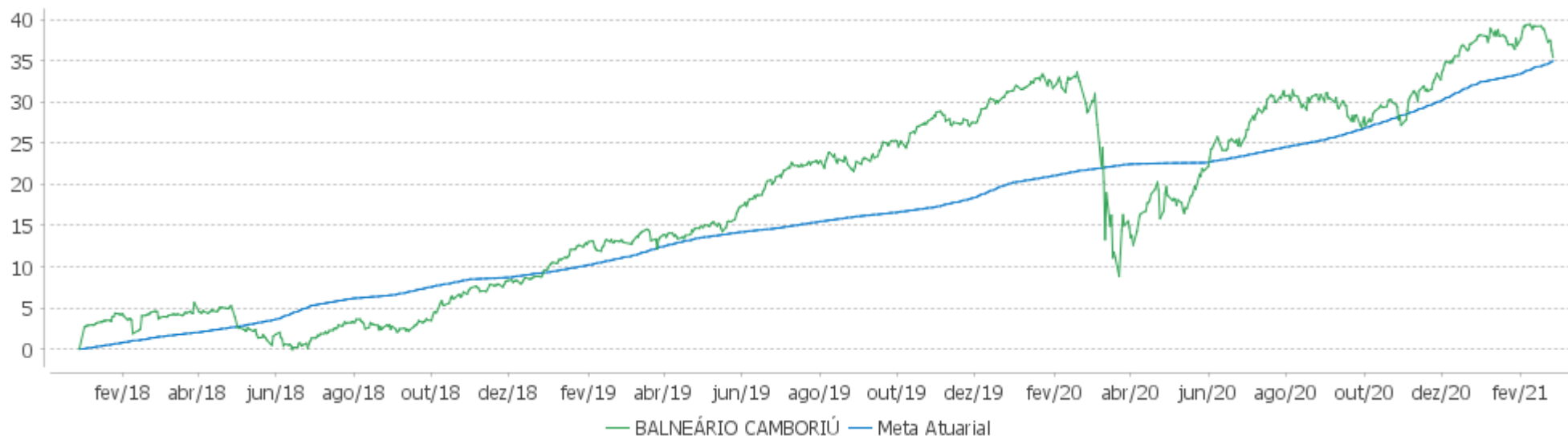
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

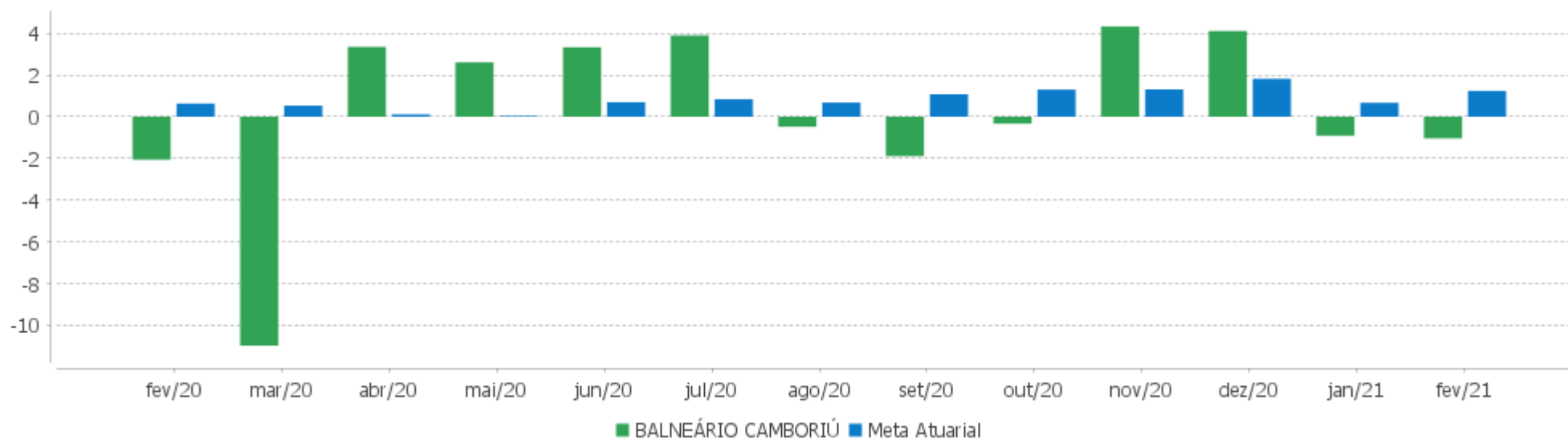
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	52,63	03 meses	2,09	3,81	-1,72	6,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	47,37	06 meses	4,15	7,81	-3,67	7,19
			12 meses	5,04	11,22	-6,18	14,92
			24 meses	19,83	22,57	-2,73	11,17
			36 meses	29,54	34,97	-5,43	9,52
Maior rentabilidade da Carteira	4,33	2020-11	Desde 29/12/2017	35,46	37,06	-1,60	9,49
Menor rentabilidade da Carteira	-10,98	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 1,02	-0,36 1,99	1,29 -1,09	2,74 -0,33	6,55 3,39	21,41 -0,33	34,77 -4,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,02	-2,40 -0,04	2,32 -0,06	2,96 -0,11	2,81 -0,35	20,93 -0,80	37,77 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	1,27 -0,06	2,60 -0,15	5,92 -0,31	18,50 -0,66	30,23 -0,95
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,61 -0,01	-0,53 -0,04	1,27 -0,06	2,60 -0,14	6,01 -0,22	18,66 -0,50	30,09 -1,09
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,61 -0,02	-0,52 -0,03	1,28 -0,05	2,64 -0,10	5,94 -0,29	18,61 -0,55	30,33 -0,86
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,51 0,01	-2,38 -0,02	2,38 -0,01	2,98 -0,09	2,97 -0,19	21,02 -0,72	37,64 -1,27
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,83 -0,14	-1,28 -0,35	0,80 -0,27	0,91 -0,39	2,52 -0,79	13,59 -1,37	24,42 -1,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,15 0,03	-1,92 0,06	0,01 0,06	-0,63 -0,05	2,87 -0,14	14,72 -0,51	25,86 -0,83
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,45 -1,69	-0,30 -2,28	1,31 -2,69	2,80 -5,59	5,57 -6,94	17,55 -6,36	39,30 2,78
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,79 -0,49	2,13 0,13	3,85 -0,06	7,49 -0,45	11,09 -0,34	22,67 -0,15	35,12 -0,13
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,86 -0,34	-3,50 -1,14	1,87 -0,51	1,64 -1,43	2,80 -0,36	21,86 0,13	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-2,40 -0,04	2,32 -0,06	2,90 -0,17	2,87 -0,29	21,09 -0,65	37,40 -1,51
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 1,50	0,27 2,63	1,48 -0,90	3,37 0,30	5,26 2,09	14,83 -6,90	26,37 -12,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -1,37	-0,48 -1,59	0,83 -1,65	1,04 -3,91	4,64 -0,55	19,53 10,12	31,08 17,41
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF Var. INPC + 6,00% p.p.	0,79 -0,45	2,14 0,16	3,87 -0,14	7,53 -0,86	11,17 -1,35	22,84 -1,07	35,41 -1,11
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,53	-2,38	2,34	2,95	2,89	21,16	37,86

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.	-0,02	-0,03	-0,05	-0,12	-0,27	-0,57	-1,05
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,84	-1,28	0,82	0,73	2,26	13,32	24,08
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01	-0,02	-0,02	-0,09	-0,30	-0,58	-0,92
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-2,32	-3,97	3,20	3,19	0,54	22,54	43,21
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,01	0,00	-0,03	-0,19	-0,41	-0,67	-1,21
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	-0,09	0,61	0,45	-0,18	-1,08	30,98	28,46
% do CDI	-69,20	214,55	100,52	-19,49	-45,75	383,96	189,81
BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	-0,79	-0,81	0,95	2,20	5,70	18,35	29,96
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,19	-0,32	-0,38	-0,55	-0,54	-0,80	-1,22
BRABESCO H FI RF NILO	-1,77	-2,85	2,24	2,77	2,99	22,81	40,52
% do CDI	-1.312,78	-1.004,30	499,57	302,14	126,58	282,72	270,26
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,09	0,24	0,45	0,64	1,99	7,48	14,16
% do CDI	64,27	83,83	99,63	70,14	84,17	92,70	94,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,24	0,60	0,88	2,00	7,44	14,14
% do CDI	57,89	84,32	134,31	95,86	84,75	92,19	94,27
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	-0,59	-0,57	1,38	2,00	6,42	21,81	46,27
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,87	-2,58	-2,53	-5,95	-5,01	-1,01	11,02
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	-2,21	-3,84	3,32	3,37	0,24	21,86	42,46
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,12	0,13	0,09	-0,00	-0,71	-1,34	-1,96
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	-0,12	-0,41	-0,30	0,34	5,49	16,63	
% do CDI	-91,01	-142,61	-66,29	36,74	232,52	206,13	
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-1,63	-2,67	2,14	2,52	3,72	24,08	41,18
% do CDI	-1.210,64	-937,89	476,67	275,70	157,58	298,49	274,66
BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	-1,24	-2,07	-0,16	-0,97	3,89	16,51	28,87
% do CDI	-921,69	-729,72	-34,82	-106,06	164,74	204,61	192,55
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,10	0,26	0,51	0,86	2,03	7,47	14,25
% do CDI	70,86	91,70	114,19	93,54	85,91	92,55	95,02
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	-0,06	-0,34	0,27	0,55	2,13		
% do CDI	-42,42	-117,88	60,85	59,95	90,10		
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	-0,15	-0,27	0,02	0,42	2,98		
% do CDI	-112,04	-93,60	5,02	45,50	126,09		
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,09	0,26	0,48	0,72	2,09	7,62	14,35
% do CDI	67,34	90,27	107,79	79,02	88,42	94,44	95,69
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	-0,74	-0,98	1,07	1,50	3,72	15,50	26,89
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,05	-0,05	0,00	0,20	0,41	0,54	0,48
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-4,38	-7,56	0,99	10,58	5,34	14,58	27,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	-0,01	-0,06	-0,16	-0,29	-0,54	-1,23
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-4,39	-7,59	1,00	10,59	5,28	14,47	28,21
Var. IBOVESPA p.p.	-0,02	-0,04	-0,05	-0,14	-0,35	-0,65	-0,71
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2,59	2,41	5,56	8,58	24,11	36,82	45,31
Var. IBOVESPA p.p.	6,97	9,96	4,51	-2,15	18,48	21,70	16,39
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	-0,03	0,45	29,36	29,55	28,52	47,18	218,78
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,31	-1,55	25,45	21,60	17,09	24,37	183,53
FIP CAIXA CYRELA	0,00	-7,59	-15,71	-98,54	-99,05	-99,15	-99,09
Var. IBOVESPA p.p.	4,37	-0,04	-16,76	-109,28	-104,68	-114,27	-128,00
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	-2,23	-6,83	-0,38	8,01	-3,99	25,15	38,37
Var. SMALL CAP p.p.	-0,39	-1,62	-2,30	-1,84	-6,19	-13,53	-16,60
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-3,23	-7,34	3,18	5,39	4,61	22,40	56,80
Var. IBOVESPA p.p.	1,14	0,20	2,13	-5,35	-1,02	7,28	27,89
BRADESCO F I A SELECTION	-3,24	-5,64	1,81	10,71	3,53	10,67	27,30
Var. IBOVESPA p.p.	1,13	1,90	0,77	-0,02	-2,10	-4,45	-1,61
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-0,97	-2,83	5,71	16,40	11,43	26,79	45,58
Var. IBOVESPA p.p.	3,40	4,71	4,67	5,67	5,80	11,67	16,66
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-4,30	-7,08	0,32	0,73	-20,50	-4,05	17,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,07	0,47	-0,72	-10,01	-26,13	-19,17	-11,42
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-10,15	-16,50	-12,80	-9,29	-32,82	0,03	9,79
% do CDI	-7.544,19	-5.806,26	-2.848,96	-1.015,37	-1.389,21	0,43	65,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,47	-1,00	5,23	12,85	4,60	25,63	48,93
Var. IBOVESPA p.p.	4,85	6,55	4,19	2,12	-1,03	10,51	20,01
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,31	-7,91	0,72	9,47	-0,18	19,66	40,76
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,89	2,11	2,69	1,82	3,35	2,32	3,47
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-2,53	-3,13	1,94	5,65	10,28	37,75	62,91
Var. IBOVESPA p.p.	1,85	4,42	0,89	-5,09	4,65	22,63	33,99
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	-3,89	-8,01	0,67	9,89	-2,59	-0,22	14,89
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,31	2,01	2,64	2,24	0,94	-17,56	-22,41
FIA CAIXA CONSUMO	-5,36	-6,66	-2,10	-1,00	-0,20	34,71	28,80
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,07	-0,16	-0,27	-0,77	-1,23	-1,44	-6,59
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-5,96	-11,84	-5,63	-0,81			
Var. IBOVESPA p.p.	-1,58	-4,30	-6,68	-11,55			
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-3,68	-5,65	2,28	7,86	5,25	25,90	51,75
Var. IBOVESPA p.p.	0,69	1,90	1,23	-2,87	-0,38	10,79	22,83
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-1,99	-5,40	1,78	8,15	-0,35	31,96	42,70

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.	2,38	2,14	0,74	-2,58	-5,98	16,84	13,78
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-3,85	-6,10	1,76	9,34	3,30	19,79	35,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,52	1,45	0,71	-1,39	-2,33	4,68	6,56
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,74	-8,92	-1,93	4,64	-7,73	1,54	14,30
Var. IBOVESPA p.p.	-0,36	-1,37	-2,98	-6,09	-13,36	-13,58	-14,61
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-0,77	-3,43	4,89	5,36	1,24	28,87	59,72
Var. IBOVESPA p.p.	3,60	4,12	3,84	-5,37	-4,39	13,75	30,80
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	-0,39	2,37	-29,97	-24,51	-25,01	-57,71	-61,12
Var. IFIX p.p.	-0,63	1,79	-32,74	-28,26	-22,40	-76,28	-86,00
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	-0,27	-0,80	-0,54	-2,24	-11,09	1,87	-87,78
Var. IFIX p.p.	-0,52	-1,37	-3,32	-5,99	-8,48	-16,69	-112,66
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	-5,61	-4,58	-6,72	-10,30	-20,31	-5,55	-10,91
Var. IFIX p.p.	-5,85	-5,16	-9,49	-14,05	-17,70	-24,12	-35,79
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,51	7,62	9,27	9,96	69,09	133,74	
Var. IBOVESPA p.p.	7,88	15,17	8,22	-0,78	63,46	118,62	
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,75	10,14	11,38	14,71	62,12	100,64	
Var. MSCI ACWI p.p.	1,52	1,93	1,13	1,14	4,58	7,57	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,42	8,91	9,10	15,21	97,35		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	3,14	6,91	5,19	7,27	85,92		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,55	9,54	10,30	8,76	68,74	114,04	150,85
Var. IBOVESPA p.p.	7,92	17,09	9,25	-1,97	63,12	98,92	121,93
BALNEÁRIO CAMBORIÚ	-1,04	-1,94	2,09	4,15	5,04	19,83	29,54
Var. IPCA + 5,42% p.p.	-2,28	-3,86	-1,68	-3,52	-5,78	-1,65	-3,51
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36	28,91	47,25
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64	49,21	92,15
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69	43,25	76,67
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19	46,55	66,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42	59,99	116,55
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91	53,99	95,10
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00	38,90	68,79
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40	40,38	70,46
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03	47,34	65,63
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08	66,90	183,79
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99	25,28	42,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92	65,06	157,13
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16	71,82	163,52
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76	65,01	151,69
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97	104,23	231,11
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88	42,27	112,08
Índice Consumo - ICON	-5,29	-6,50	-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39	68,99	99,88
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29	61,70	208,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66	16,90	22,46
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73	16,81	22,29
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21	47,59	55,52
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00	25,31	42,72

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,63	7,98	9,15	10,05	58,59	102,47	139,34	187,26	174,09
MSCI ACWI	3,23	8,21	10,25	13,57	57,54	93,07	116,17	163,31	145,71
MSCI World	3,47	7,88	9,50	12,25	56,56	93,39	119,42	164,33	144,92

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,14	1,71	3,44	6,96	9,35	18,26	27,78	36,61	48,83
IPCA + 5,00%	1,21	1,86	3,67	7,45	10,39	20,53	31,48	41,90	56,08
IPCA + 5,50%	1,25	1,93	3,79	7,70	10,91	21,67	33,36	44,60	59,81
IPCA + 5,89%	1,27	1,99	3,88	7,89	11,32	22,56	34,83	46,74	62,77
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25	47,34	63,62
INPC + 4,00%	1,10	1,69	3,53	7,39	10,41	19,31	28,98	36,50	48,63
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52	47,23	63,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

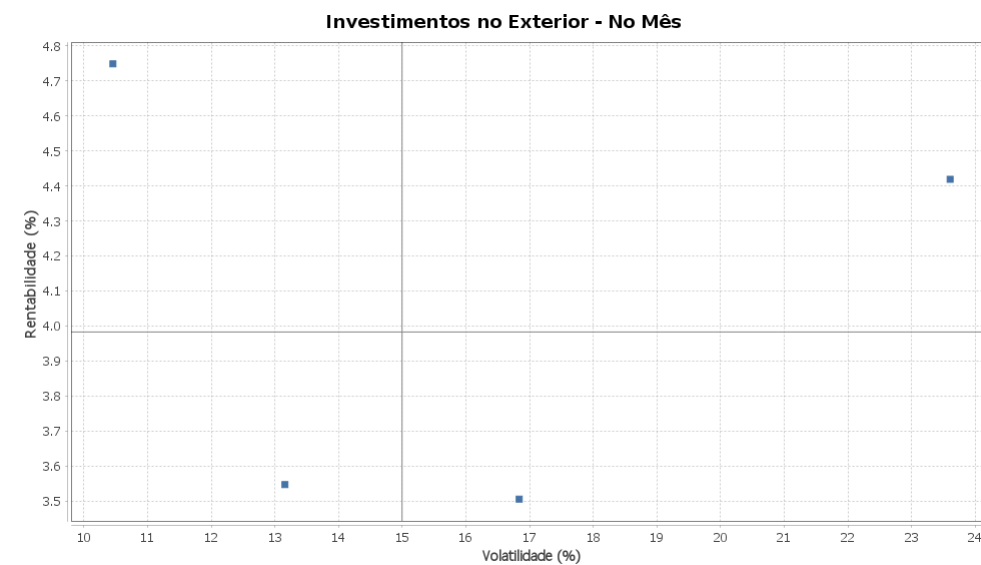
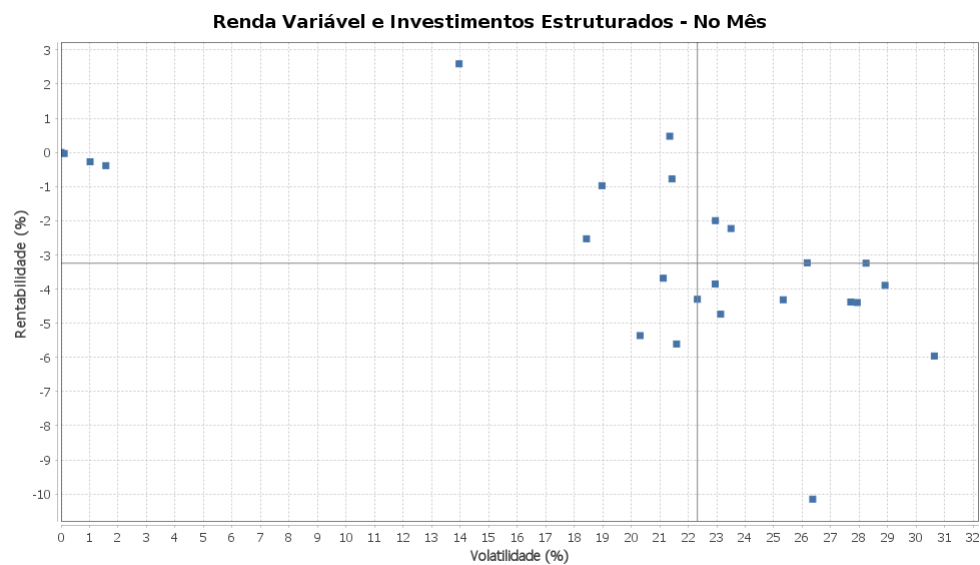
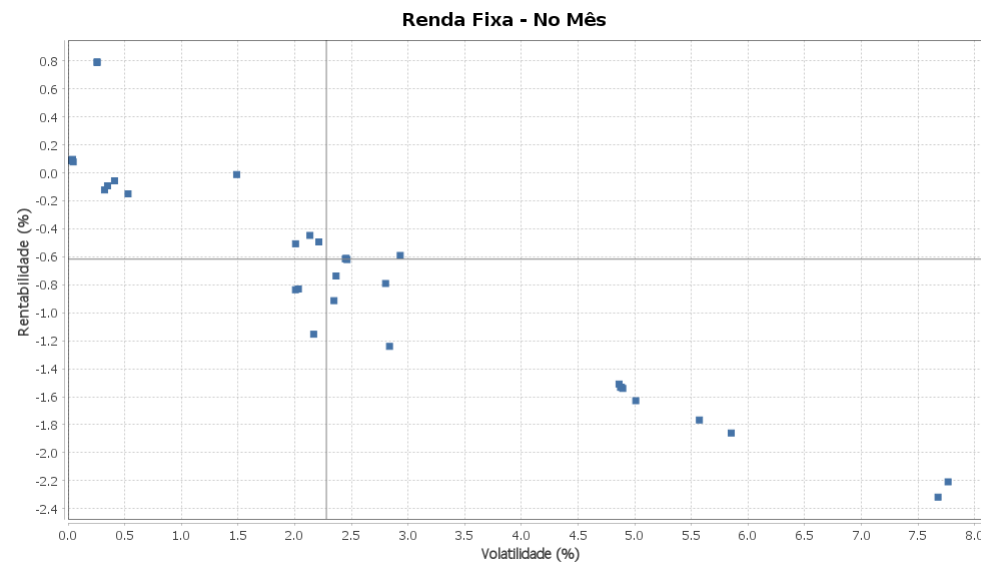
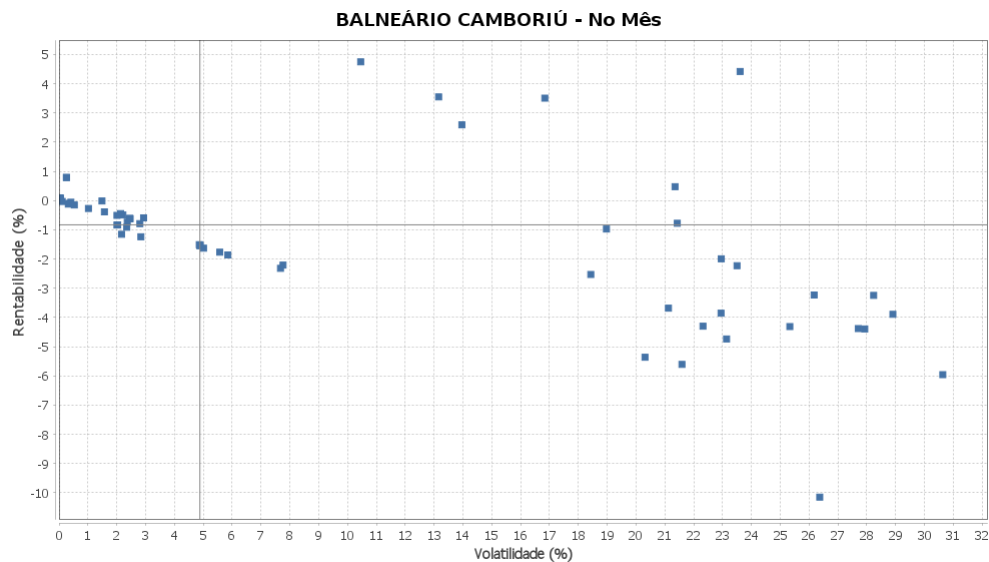
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
37	01/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.820,18	2.354,75957800	3,7456820000
39	01/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.669,74095600	3,7456820000
45	01/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	515.000,00	137.491,65028500	3,7456820000
40	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	202.000,00	53.923,48122300	3,7460490000
46	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	564.422,96	150.671,53683200	3,7460490000
38	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.000,00	1.067,53891600	3,7469360000
20	09/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	18.987,46	0,00	8.232,09390400	2,3065164490
47	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	264.951,01	0,00	70.708,09503800	3,7471100000
48	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.473,10	0,00	2.527,75484479	3,7476340000
49	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	115.807,46	30.901,48606100	3,7476340000
50	12/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.308,19	0,00	8.086,93696200	3,7477960000
51	12/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	190.624,50	0,00	50.863,09393500	3,7477960000
18	17/02/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	23.204,49	9.995,10481900	2,3215854580
21	17/02/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	82.576,70	34.683,81605700	2,3808424040
24	17/02/2021	BB PREV RF VII	0,00	7.540,65	4.072,02911500	1,8518163270
19	18/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.204,49	0,00	10.057,12388100	2,3072689840
22	18/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.101.791,95	0,00	910.943,61540600	2,3072689840
52	18/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.661.387,26	0,00	443.265,32757500	3,7480650000
25	19/02/2021	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	0,00	8.365.847,51	8.876,34537370	942,4878323000
31	19/02/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	500.000,00	10.219,15342407	48,9277320000
35	19/02/2021	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	0,00	500.000,00	2.480,35554686	201,5840030000
41	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.668,00494200	3,7481190000
53	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	348.776,21	0,00	93.053,66505100	3,7481190000
54	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.119.257,95	0,00	298.618,57374300	3,7481190000
55	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.500.000,00	400.200,74025500	3,7481190000
27	22/02/2021	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	500.000,00	0,00	195.932,36571481	2,5519010000
28	22/02/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	174.379,04493992	5,7346340000
30	22/02/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	100.000,00	0,00	3.473,16383553	28,7921920000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
32	22/02/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	100.000,00	2.043,73891489	48,9299290000
33	22/02/2021	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	24.356,67209138	20,5282560000
56	22/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.000.000,00	0,00	266.802,13100100	3,7480960000
57	22/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.086.163,38	0,00	556.592,83540200	3,7480960000
58	22/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.054.997,76	0,00	281.475,65057000	3,7480960000
59	22/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	266.802,13087900	3,7480960000
60	22/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	266.802,13106600	3,7480960000
26	23/02/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	8.365.847,51	0,00	687.558,94234412	12,1674623000
29	23/02/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	2.344,67904940	213,2488027000
34	23/02/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	500.000,00	0,00	1.981,54534507	252,3283160000
36	23/02/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	522,54134081	956,8620910000
23	24/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	190.624,50	0,00	82.607,81621300	2,3075843030
42	24/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.100,00	293,47138000	3,7482360000
61	24/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.688.495,34	984.061,66080100	3,7482360000
43	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	56.530,79	15.081,85511000	3,7482650000
44	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	30.814,29	8.220,94750900	3,7482650000
62	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	100.000,00	26.679,01016200	3,7482650000
111	26/02/2021	FIP CAIXA CYRELA	0,00	0,00	2.911,86409900	0,0000001000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 19.416.395,15

Value-At-Risk: 3,27%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP CAIXA CYRELA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-2,65	0,09	974.035,14	0,16
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,04	0,00	-2,53	0,09	12.726.021,65	2,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	-1,00	0,10	10.763.373,25	1,81
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,05	0,00	-1,25	0,08	16.093.481,21	2,71
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,11	1,18	-0,00	-1,50	-0,03	1.097.566,99	0,19
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,16	0,00	2,55	0,79	5.910.240,00	1,00
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,16	0,00	2,57	0,79	2.941.618,00	0,50
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,32	0,25	-0,00	-0,80	-0,12	11.169.035,81	1,88
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,35	0,00	-0,00	-0,65	-0,09	1.945.626,09	0,33
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,41	0,35	0,00	-0,47	-0,06	1.511.121,05	0,25
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,53	0,23	0,00	-0,54	-0,15	25.067.695,93	4,23
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	1,02	0,10	0,00	-0,40	-0,27	1.114.920,00	0,19
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,80	0,00	-0,10	-0,01	277.087,28	0,05
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,57	1,94	-0,00	-0,33	-0,39	66.648,72	0,01
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,03	0,00	-0,48	-0,84	4.504.659,92	0,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,01	-0,32	-0,51	12.974.127,90	2,19
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,03	1,04	0,01	-0,47	-0,83	9.744.774,39	1,64
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	1,08	0,00	-0,27	-0,45	861.900,87	0,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,17	1,35	0,00	-0,59	-1,15	33.602,12	0,01
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	1,09	0,00	-0,28	-0,49	3.204.460,51	0,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,03	-0,45	-0,91	19.994.479,35	3,37
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,36	1,16	0,00	-0,37	-0,74	3.478.835,18	0,59
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,45	1,22	0,06	-0,31	-0,61	50.553.658,04	8,52
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,45	1,23	0,00	-0,30	-0,61	3.138.389,87	0,53
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	1,23	0,03	-0,31	-0,62	25.249.384,93	4,26
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,80	1,37	0,01	-0,33	-0,79	5.067.729,37	0,85
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,84	1,54	0,01	-0,48	-1,24	5.027.038,61	0,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	2,93	1,31	0,01	-0,25	-0,59	6.483.787,50	1,09
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,86	2,29	0,01	-0,34	-1,51	2.490.321,91	0,42
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,87	2,28	0,11	-0,34	-1,53	45.427.131,04	7,66
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	2,28	0,01	-0,34	-1,53	3.417.556,23	0,58
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,29	0,16	-0,34	-1,54	68.192.538,18	11,49
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,01	2,73	0,04	-0,35	-1,63	13.014.235,36	2,19
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,57	2,71	0,07	-0,34	-1,77	25.070.514,91	4,23
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	3,02	0,00	-0,34	-1,86	1.180.099,90	0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,68	3,88	0,02	-0,32	-2,32	4.424.939,88	0,75
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,76	3,90	0,01	-0,30	-2,21	2.842.137,88	0,48
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	10,46	8,52	0,00	0,44	4,75	1.553.521,78	0,26
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,16	11,52	0,05	0,26	3,55	9.497.377,75	1,60
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	13,96	8,01	0,11	0,18	2,59	11.824.676,93	1,99
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,84	11,33	0,03	0,20	3,51	5.239.048,84	0,88
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,43	9,67	0,12	-0,14	-2,53	8.377.578,50	1,41
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,97	10,91	0,06	-0,06	-0,97	3.625.068,23	0,61
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	20,31	10,19	0,05	-0,27	-5,36	3.222.458,70	0,54
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	21,12	10,63	0,00	-0,18	-3,68	190.150,93	0,03
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,35	10,05	0,16	0,02	0,47	9.994.242,63	1,68
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,43	10,46	0,34	-0,04	-0,77	21.037.395,98	3,55
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	21,59	0,50	0,00	-0,27	-5,61	546.625,26	0,09
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	22,32	10,29	0,09	-0,20	-4,30	5.173.667,51	0,87
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	22,95	10,66	0,08	-0,17	-3,85	4.673.865,26	0,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,95	10,46	0,20	-0,09	-1,99	11.950.855,95	2,01
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	23,14	10,10	0,15	-0,21	-4,74	9.835.097,26	1,66
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,50	11,54	0,31	-0,10	-2,23	17.044.750,51	2,87
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	23,61	13,01	0,09	0,18	4,42	16.948.720,71	2,86
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,33	11,12	0,04	-0,18	-4,31	2.466.294,64	0,42
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,17	11,00	0,05	-0,13	-3,23	2.999.951,65	0,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	26,37	17,89	0,05	-0,39	-10,15	2.211.043,15	0,37
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	27,70	12,37	0,27	-0,16	-4,38	14.078.512,70	2,37
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	27,93	NaN	0,00	-0,16	-4,39	0,00	0,00
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	28,24	13,98	0,20	-0,12	-3,24	10.040.609,73	1,69
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	28,90	11,93	0,15	-0,14	-3,89	8.782.799,29	1,48
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,63	12,69	0,07	-0,20	-5,96	3.921.452,13	0,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de fevereiro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 5,78% 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;