



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
MARÇO 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 31.03.2021.

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

67,06%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	7,62	-0,49	-2,86	2.477.995,98	0,41	288.919.595,36	0,86
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3,03	0,33	-0,21	3.148.620,40	0,52	1.638.822.928,33	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	7,89	-0,48	-2,86	3.401.148,99	0,57	383.111.308,48	0,89
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,89	-0,48	-2,85	45.209.609,66	7,52	7.644.309.269,72	0,59
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	67.868.768,86	11,29	5.996.206.078,69	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,53	-0,39	-1,67	9.706.360,74	1,61	1.101.354.485,14	0,88
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	0,31	-0,23	25.122.078,25	4,18	13.551.415.614,90	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,49	-1,19	-5,12	4.863.602,11	0,81	1.420.869.422,66	0,34
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,53	-1,74	-1,74	491.275,91	0,08	1.580.616.679,30	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,50	-0,43	-1,71	4.485.084,74	0,75	477.073.924,53	0,94
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	-0,89	-2,79	33.303,94	0,01	1.953.428.365,60	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	3,01	0,32	-0,20	50.716.224,85	8,44	5.244.113.078,65	0,97
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	3,36	0,28	-0,08	3.213.547,60	0,53	287.765.442,25	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	1,69	0,39	0,67	278.171,93	0,05	240.972.949,54	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	19.910.273,64	3,31	9.507.617.903,00	0,21
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	13.013.186,42	2,16	15.491.489.347,05	0,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	9,26	-0,82	-4,28	1.170.473,09	0,19	1.525.094.042,58	0,08
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,58	0,29	-0,01	864.441,40	0,14	573.145.488,03	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	1,72	3,88	6.011.772,00	1,00	202.179.826,16	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,51	1,73	3,90	2.992.366,00	0,50	228.887.898,64	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,25	-0,12	-1,59	264.978.306,51	44,08		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,26	0,19	0,42	11.147.644,61	1,85	7.439.260.421,73	0,15
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8,53	-0,74	-3,39	12.917.463,81	2,15	700.314.494,78	1,84
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,18	0,16	0,42	274.859,93	0,05	20.676.730.524,09	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,10	0,34	14.237.586,21	2,37	5.408.705.211,16	0,26
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3,89	-0,63	-1,61	3.456.955,44	0,58	711.069.740,23	0,49
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,19	0,24	0,50	11.545.130,32	1,92	3.129.027.750,94	0,37
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	12,47	-1,15	-4,95	3.299.488,61	0,55	215.350.580,41	1,53
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	9,11	-0,86	-3,69	24.854.050,72	4,13	764.834.933,49	3,25
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3,29	0,09	-0,72	5.072.358,65	0,84	1.065.355.221,87	0,48
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	3,75	-0,90	-2,96	4.981.758,78	0,83	500.079.676,72	1,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	0,69	0,89	0,48	11.268.446,32	1,87	731.785.851,87	1,54
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	3,77	0,37	-0,21	6.507.632,03	1,08	84.565.918,12	7,70
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,68	0,41	0,14	25.169.604,80	4,19	2.249.680.851,56	1,12
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	0,73	0,06	-0,27	1.512.081,55	0,25	525.954.327,12	0,29
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,76	-0,08	-1,15	136.245.061,78	22,66		

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	2,71	-0,18	0,43	1.942.169,27	0,32	109.674.513,89	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,71	-0,18	0,43	1.942.169,27	0,32		
Renda Fixa			4,78	-0,11	-1,43	403.165.537,56	67,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,05%

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	26,67	3,41	3,41	1.034.072,06	0,17	342.767.846,36	0,30
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	26,41	5,94	-2,07	15.424.828,89	2,57	797.782.444,27	1,93
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			26,49	5,94	-2,06	16.458.900,95	2,74		

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	25,49	0,16	-5,50	10.156.357,97	1,69	736.778.248,58	1,38
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	29,27	3,79	-3,30	17.690.754,04	2,94	507.196.001,93	3,49
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	24,62	5,87	-3,57	10.412.504,71	1,73	1.002.558.255,25	1,04
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	25,06	6,56	-1,97	9.359.067,23	1,56	1.624.645.482,75	0,58
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,39	3,12	-0,41	21.693.449,09	3,61	2.141.846.289,54	1,01
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	25,48	3,89	-2,44	4.956.993,12	0,82	981.481.248,05	0,51
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	43,81	9,55	-8,53	2.527.517,62	0,42	431.633.256,76	0,59
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	26,44	1,73	-1,46	8.621.720,36	1,43	2.831.568.584,73	0,30
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	25,35	2,91	-0,00	3.832.803,50	0,64	988.569.327,17	0,39
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	26,95	5,53	-2,22	3.165.989,20	0,53	1.133.002.277,10	0,28
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	27,27	2,13	-4,67	3.390.858,08	0,56	630.846.852,38	0,54
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	24,71	5,62	-2,74	2.604.841,89	0,43	979.013.916,36	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,90	4,73	-0,93	12.516.196,75	2,08	1.134.931.034,81	1,10
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	26,05	-1,18	-6,89	289.833,79	0,05	2.066.276.030,96	0,01
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	26,61	2,12	1,10	10.205.901,60	1,70	3.385.715.282,16	0,30
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	30,40	3,58	-3,76	5.358.743,64	0,89	1.088.808.596,09	0,49
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	31,74	6,25	-6,34	4.269.735,03	0,71	1.128.106.972,08	0,38
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			25,88	3,73	-2,36	131.053.267,62	21,80		

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	20,61	4,07	6,58	12.305.428,69	2,05	1.037.182.533,83	1,19
Sub-total Artigo 8º III			20,61	4,07	6,58	12.305.428,69	2,05		

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	25,63	2,91	3,38	1.129.542,78	0,19	19.546.735,85	5,78
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			25,63	2,91	2,49	1.129.542,78	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	8,05	-3,74	-4,51	1.073.196,00	0,18	146.231.801,97	0,73
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	14,57	0,96	-3,67	551.795,76	0,09	730.601.750,67	0,08
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	39,18	0,72	3,11	67.130,74	0,01	11.507.603,06	0,58
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			8,58	-2,08	-3,96	1.692.122,50	0,28		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			24,18	3,89	-1,75	162.639.262,54	27,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,88%

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	25,95	1,74	9,50	5.839.839,84	0,97	280.751.899,79	2,08
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	22,18	-1,40	-1,40	246.489,80	0,04	443.487.803,45	0,06
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,94	0,94	0,94	252.359,18	0,04	159.619.906,86	0,16
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23,80	4,04	9,27	2.126.465,44	0,35	460.985.263,24	0,46
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,58	-2,14	6,58	17.073.271,10	2,84	1.676.325.591,46	1,02
Sub-total Artigo 9º A, II			25,77	-0,77	7,80	25.538.425,36	4,25		

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	24,18	3,43	13,29	9.822.926,16	1,63	2.719.540.696,03	0,36
Sub-total Artigo 9º A, III			24,18	3,43	13,29	9.822.926,16	1,63		
Investimentos no Exterior			23,30	0,38	9,39	35.361.351,52	5,88		
Total			8,54	0,97	-0,99	601.166.151,62	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	264.978.306,51	44,08	0,00	52,11	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	136.245.061,78	22,66	0,00	11,45	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.942.169,27	0,32	0,00	0,35	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	403.165.537,56	67,06					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	16.458.900,95	2,74	0,00	2,00	30,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	131.053.267,62	21,80	0,00	19,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	12.305.428,69	2,05	0,00	4,55	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.129.542,78	0,19	0,00	0,20	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.692.122,50	0,28	0,00	0,34	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	162.639.262,54	27,05					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	25.538.425,36	4,25	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.822.926,16	1,63	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	35.361.351,52	5,88					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	-0,12 -62,15	-1,59 -327,47	-1,59 -327,47	3,42 355,95	8,25 371,36	-337.663,81	-4.279.181,24
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,08 -40,72	-1,15 -236,61	-1,15 -236,61	1,94 202,01	5,53 248,82	-126.901,66	-1.590.855,61
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,18 -88,36	0,43 88,71	0,43 88,71	-0,13 -13,14	-1,06 -47,55	-3.456,82	8.335,49
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,94 -0,06	-2,06 -0,06	-2,06 -0,06	23,01 -0,28	58,94 -0,79	880.388,25	-287.197,95
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,73 -2,26	-2,36 -0,36	-2,36 -0,36	16,79 -6,50	53,30 -6,43	4.705.985,57	-3.127.877,47
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,07 -1,93	6,58 8,58	6,58 8,58	18,69 -4,60	51,16 -8,57	480.751,76	740.164,72
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,91 -3,08	2,49 4,49	2,49 4,49	-13,98 -37,26	-35,21 -94,93	31.975,79	27.425,75
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,08 -8,08	-3,96 -1,95	-3,96 -1,95	-8,03 -31,32	0,43 -59,30	-35.998,19	-69.691,62
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,77 -384,35	7,80 1.604,91	7,80 1.604,91	11,01 1.147,52	78,52 3.533,06	-202.865,97	1.540.538,07
Artigo 9º A, III % do CDI	3,43 1.704,61	13,29 2.735,98	13,29 2.735,98	14,78 1.539,99	64,18 2.887,68	325.548,41	1.067.912,03
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						5.717.763,33	-5.970.427,83

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	19.994.479,35	0,00	0,00	0,00	19.910.273,64	-84.205,71	-380.706,30
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.504.659,92	0,00	0,00	0,00	4.485.084,74	-19.575,18	-77.992,34
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	50.553.658,04	0,00	0,00	0,00	50.716.224,85	162.566,81	-101.010,81
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	45.427.131,04	0,00	0,00	0,00	45.209.609,66	-217.521,38	-1.326.648,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.424.939,88	500.000,00	0,00	0,00	4.863.602,11	-61.337,77	-244.485,38

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	861.900,87	0,00	0,00	0,00	864.441,40	2.540,53	65,74
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	3.204.460,51	0,00	0,00	0,00	3.213.547,60	9.087,09	-2.123,53
BB PREV RF VII	277.087,28	0,00	0,00	0,00	278.171,93	1.084,65	1.894,67
BTG PACTUAL TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF	2.490.321,91	0,00	0,00	0,00	2.477.995,98	-12.325,93	-73.027,82
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.910.240,00	0,00	0,00	0,00	6.011.772,00	101.532,00	227.700,08
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	2.941.618,00	0,00	0,00	0,00	2.992.366,00	50.748,00	113.921,22
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	500.000,00	0,00	0,00	491.275,91	-8.724,09	-8.724,09
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.744.774,39	0,00	0,00	0,00	9.706.360,74	-38.413,65	-165.097,50
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.249.384,93	0,00	-205.000,00	0,00	25.122.078,25	77.693,32	-58.629,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	68.192.538,18	0,00	0,00	0,00	67.868.768,86	-323.769,32	-2.000.341,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.602,12	0,00	0,00	0,00	33.303,94	-298,18	-954,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.974.127,90	0,00	0,00	0,00	13.013.186,42	39.058,52	-23.829,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.417.556,23	0,00	0,00	0,00	3.401.148,99	-16.407,24	-100.297,94
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.138.389,87	0,00	0,00	0,00	3.148.620,40	10.230,53	-6.502,17
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.180.099,90	0,00	0,00	0,00	1.170.473,09	-9.626,81	-52.392,10
					264.978.306,51	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	6.483.787,50	0,00	0,00	0,00	6.507.632,03	23.844,53	-13.443,12
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.763.373,25	2.255.275,48	-1.500.000,00	0,00	11.545.130,32	26.481,59	48.839,51
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5.027.038,61	0,00	0,00	0,00	4.981.758,78	-45.279,83	-151.750,82
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	12.726.021,65	0,00	-1.600.000,00	0,00	11.147.644,61	21.622,96	32.929,97
BRADESCO H FI RF NILO	25.070.514,91	0,00	0,00	0,00	24.854.050,72	-216.464,19	-953.121,27
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.067.729,37	0,00	0,00	0,00	5.072.358,65	4.629,28	-36.809,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3.478.835,18	0,00	0,00	0,00	3.456.955,44	-21.879,74	-56.449,50
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	2.842.137,88	500.000,00	0,00	0,00	3.299.488,61	-42.649,27	-156.210,62
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.093.481,21	6.396.519,25	-8.268.874,14	0,00	14.237.586,21	16.459,89	58.313,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	11.169.035,81	0,00	0,00	0,00	11.268.446,32	99.410,51	53.953,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	974.035,14	0,00	-700.000,00	0,00	274.859,93	824,79	6.342,75
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	25.067.695,93	0,00	0,00	0,00	25.169.604,80	101.908,87	35.041,81
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	13.014.235,36	0,00	0,00	0,00	12.917.463,81	-96.771,55	-453.194,79
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1.511.121,05	0,00	0,00	0,00	1.512.081,55	960,50	-5.298,38
					136.245.061,78	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	1.945.626,09	0,00	0,00	0,00	1.942.169,27	-3.456,82	8.335,49
					1.942.169,27	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	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	1.034.072,06	34.072,06	-11.266,00
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	14.078.512,70	500.000,00	0,00	0,00	15.424.828,89	846.316,19	-275.931,95
					16.458.900,95	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	3.625.068,23	100.000,00	0,00	0,00	3.832.803,50	107.735,27	2.008,86
BB AÇÕES DIVIDENDOS	9.835.097,26	0,00	0,00	0,00	10.412.504,71	577.407,45	-385.267,78
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	17.044.750,51	0,00	0,00	0,00	17.690.754,04	646.003,53	-603.039,46
BRADESCO F I A SELECTION	10.040.609,73	100.000,00	0,00	0,00	10.156.357,97	15.748,24	-584.763,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21.037.395,98	0,00	0,00	0,00	21.693.449,09	656.053,11	-90.289,69
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	8.782.799,29	0,00	0,00	0,00	9.359.067,23	576.267,94	-188.048,86
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	8.377.578,50	100.000,00	0,00	0,00	8.621.720,36	144.141,86	-126.365,10
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	2.211.043,15	100.000,00	0,00	0,00	2.527.517,62	216.474,47	-220.525,27
FIA CAIXA CONSUMO	3.222.458,70	100.000,00	0,00	0,00	3.390.858,08	68.399,38	-161.607,71
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	11.950.855,95	0,00	0,00	0,00	12.516.196,75	565.340,80	-117.382,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	2.466.294,64	0,00	0,00	0,00	2.604.841,89	138.547,25	-73.385,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9.994.242,63	0,00	0,00	0,00	10.205.901,60	211.658,97	110.950,17
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.673.865,26	100.000,00	0,00	0,00	4.956.993,12	183.127,86	-120.429,59
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	5.173.667,51	0,00	0,00	0,00	5.358.743,64	185.076,13	-209.167,36
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	190.150,93	100.000,00	0,00	0,00	289.833,79	-317,14	-10.166,21
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	3.921.452,13	100.000,00	0,00	0,00	4.269.735,03	248.282,90	-278.625,06
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	2.999.951,65	0,00	0,00	0,00	3.165.989,20	166.037,55	-71.772,29
					131.053.267,62	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	11.824.676,93	0,00	0,00	0,00	12.305.428,69	480.751,76	740.164,72
					12.305.428,69	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	1.097.566,99	0,00	0,00	0,00	1.129.542,78	31.975,79	36.926,87
					1.129.542,78	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	1.114.920,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.073.196,00	-41.724,00	-50.692,00
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	546.625,26	0,00	0,00	0,00	73,29	551.795,76	5.243,79	-21.022,35
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	66.648,72	0,00	0,00	0,00	0,00	67.130,74	482,02	2.022,73
						1.692.122,50	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	5.239.048,84	500.000,00	0,00	0,00	5.839.839,84	100.791,00	442.097,16
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	0,00	250.000,00	0,00	0,00	246.489,80	-3.510,20	-3.510,20
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,00	250.000,00	0,00	0,00	252.359,18	2.359,18	2.359,18
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.553.521,78	500.000,00	0,00	0,00	2.126.465,44	72.943,66	126.465,44
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16.948.720,71	500.000,00	0,00	0,00	17.073.271,10	-375.449,61	973.126,49
					25.538.425,36	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	9.497.377,75	0,00	0,00	0,00	9.822.926,16	325.548,41	1.067.912,03
					9.822.926,16	0,00	0,00

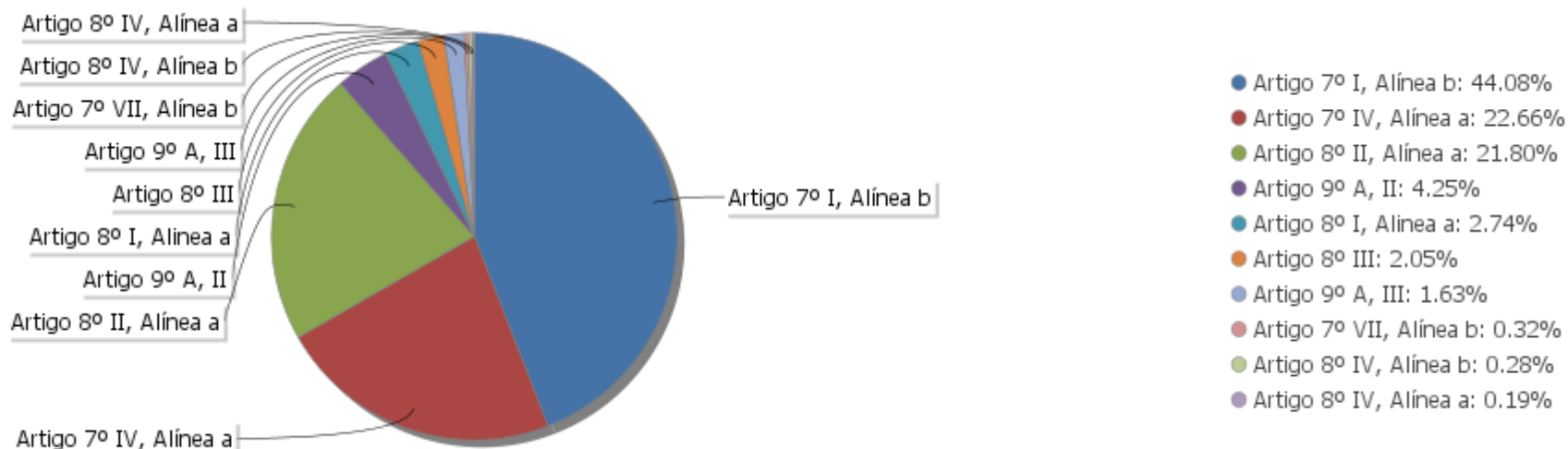
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

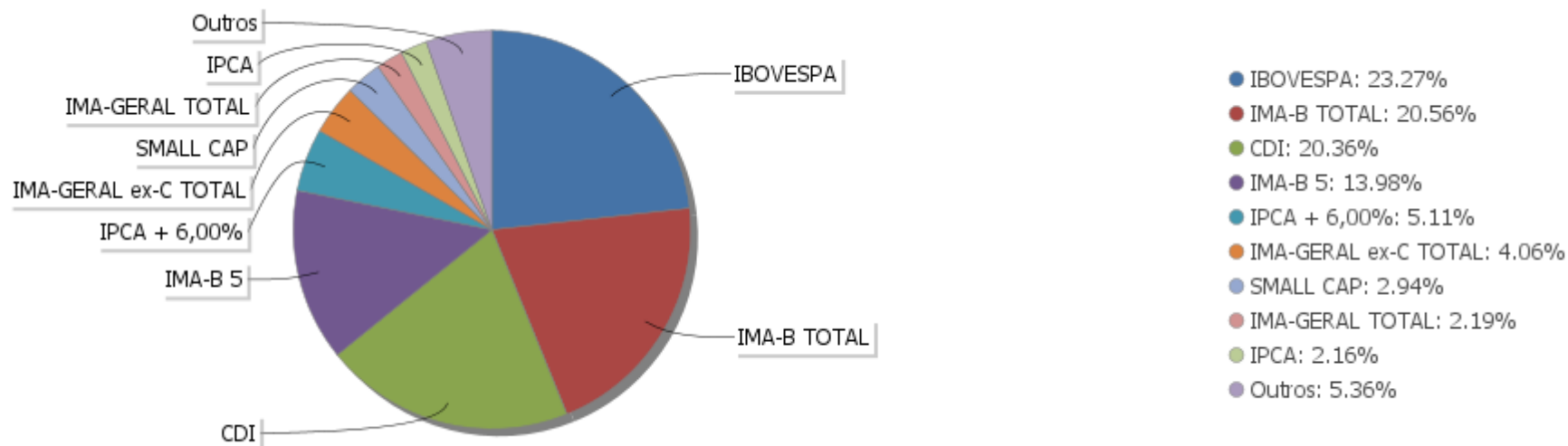
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	550.654.306,66	91,60	550.654.306,66	91,60
de 31 a 365 dias	34.079.833,98	5,67	584.734.140,64	97,27
acima de 365 dias	16.432.010,98	2,73	601.166.151,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

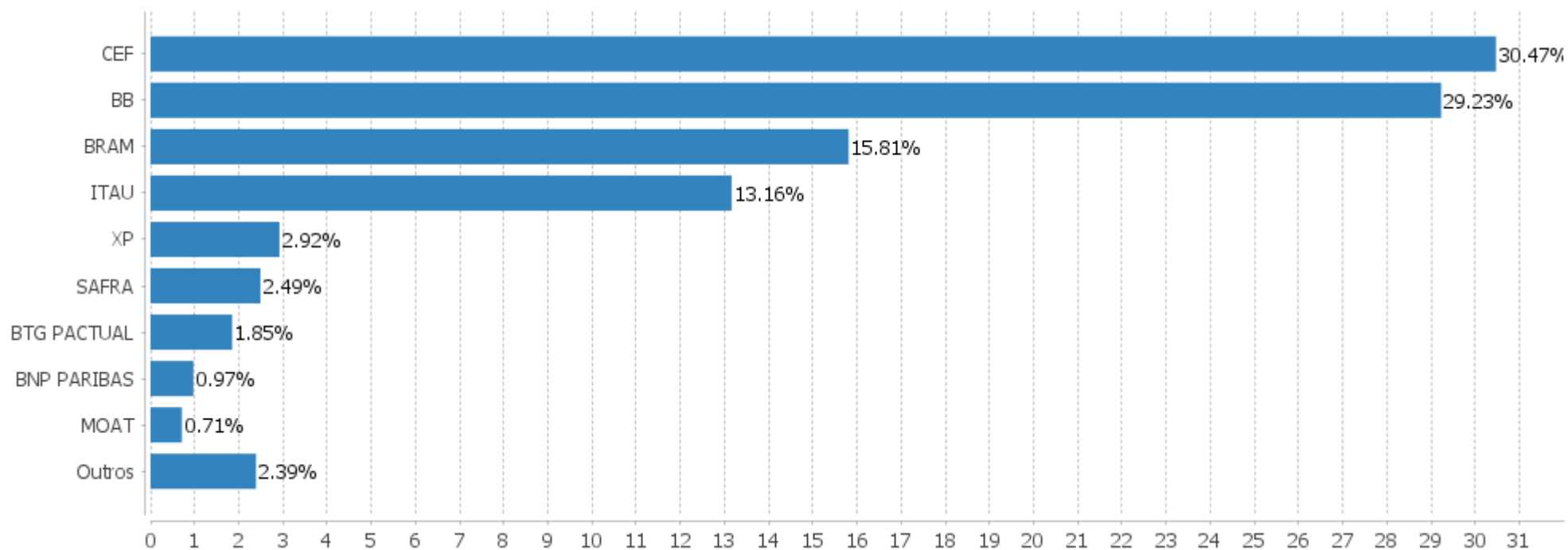


Alocação Por Estratégia



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	0,97										-0,99
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42										3,36
p.p. indexador	-1,59	-2,28	-0,45										-4,36
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

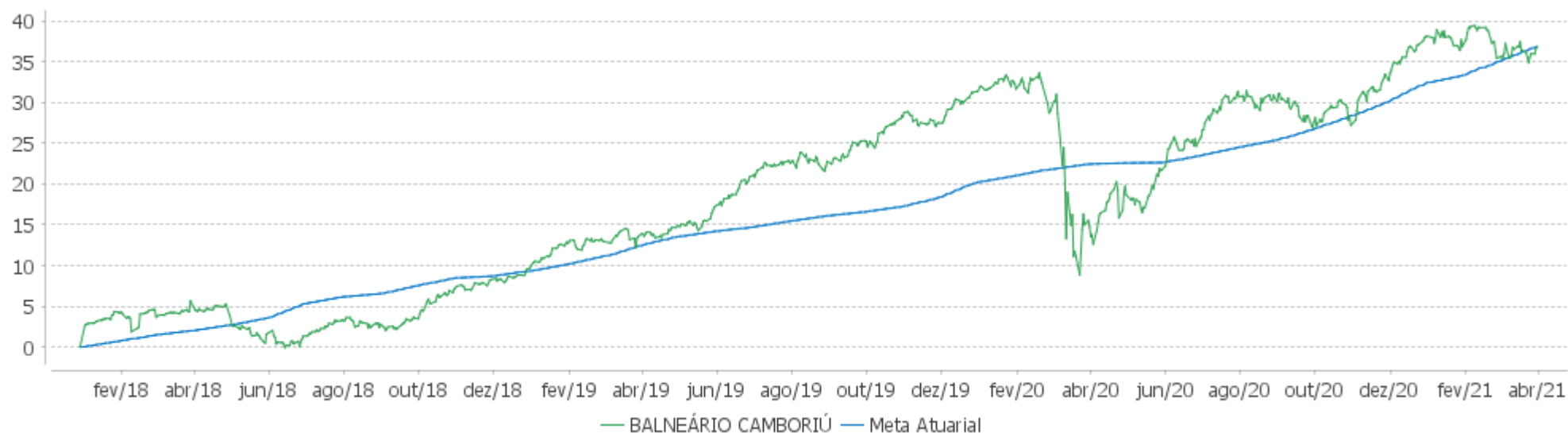
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	51,28	03 meses	-0,99	3,36	-4,36	7,29
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	48,72	06 meses	7,18	8,13	-0,95	7,05
			12 meses	19,15	12,16	6,99	8,54
			24 meses	20,46	22,84	-2,38	11,17
			36 meses	29,47	36,10	-6,63	9,55
Maior rentabilidade da Carteira	4,33	2020-11	Desde 29/12/2017	36,78	39,00	-2,23	9,44
Menor rentabilidade da Carteira	-10,98	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-0,18 -88,36	0,43 88,71	0,43 88,71	-0,13 -13,14	-1,06 -47,55	30,89 396,96	28,44 194,56
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,28 0,74	-0,08 2,73	-0,08 2,73	3,17 -1,00	9,10 -1,28	20,75 0,27	32,41 -4,58
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,01	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,06 -0,11	10,15 -0,24	19,69 -0,79	35,87 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,03	-0,23 -0,08	-0,23 -0,08	3,08 -0,14	8,20 -0,30	17,97 -0,67	28,58 -0,95
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,02	-0,21 -0,06	-0,21 -0,06	3,09 -0,13	8,21 -0,29	18,15 -0,49	28,48 -1,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	-0,20 -0,05	-0,20 -0,05	3,13 -0,10	8,22 -0,28	18,09 -0,54	28,68 -0,85
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 -0,03	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,01 -0,16	9,76 -0,62	19,78 -0,70	35,74 -1,25
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,29 -1,10	-0,01 -3,42	-0,01 -3,42	3,21 -5,22	7,72 -5,58	17,04 -7,10	38,67 1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,89 -0,04	-2,79 0,01	-2,79 0,01	-0,91 -0,04	2,08 -0,17	13,08 -0,51	23,14 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,39 -0,00	-1,67 -0,35	-1,67 -0,35	1,13 -0,38	4,17 -0,81	12,58 -1,30	22,79 -1,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,20 -0,03	-5,15 -0,05	-5,15 -0,05	4,87 -0,03	11,75 -0,26	20,41 -0,83	40,66 -1,53
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,72 0,25	3,88 0,38	3,88 0,38	8,38 0,07	12,13 -0,28	23,56 0,41	36,45 -0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,02	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,02 -0,15	10,02 -0,37	19,85 -0,62	35,54 -1,45
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,82 -0,35	-4,28 -1,48	-4,28 -1,48	2,96 -1,21	9,28 -1,10	20,28 -0,20	
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39 0,85	0,67 3,47	0,67 3,47	3,58 -0,59	7,11 -3,28	14,53 -5,95	25,28 -11,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,42 -0,04	-1,88 -0,24	-1,88 -0,24	1,24 0,09	4,35 0,17	13,27 0,41	23,79 0,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,30	-0,18	-0,18	1,85	5,09	19,24	29,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	-0,63	-2,24	-2,24	-3,39	-1,01	9,64	15,33
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,48	-2,85	-2,85	4,08	10,09	19,91	35,98
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,09	-0,30	-0,56	-1,01
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	1,73	3,90	3,90	8,42	12,21	23,73	36,73
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,33	0,49	0,49	-0,01	-1,09	-0,41	-0,93
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,43	-1,71	-1,71	1,08	3,90	12,24	22,40
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,05	-0,07	-0,07	-0,06	-0,28	-0,62	-0,95
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,19	-5,12	-5,12	4,73	11,48	20,58	41,05
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,02	-0,02	-0,16	-0,53	-0,66	-1,14
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,09	-0,72	-0,72	2,48	7,71	17,60	27,97
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,25	-0,57	-0,57	-0,74	-0,79	-1,04	-1,57
BRADESCO H FI RF NILO	-0,86	-3,69	-3,69	3,55	10,44	21,22	37,47
% do CDI	-429,38	-760,11	-760,11	369,73	469,96	272,75	256,36
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,19	0,42	0,42	0,86	1,85	7,19	13,78
% do CDI	92,16	87,27	87,27	89,29	83,28	92,41	94,30
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,10	0,34	0,34	0,98	1,96	7,05	13,66
% do CDI	49,18	69,73	69,73	102,09	88,11	90,55	93,48
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	0,37	-0,21	-0,21	2,69	8,88	21,05	45,75
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,10	-3,71	-3,71	-5,62	-3,54	-2,10	9,30
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	0,89	0,48	0,48	1,19	2,86	16,45	
% do CDI	442,62	99,02	99,02	123,52	128,72	211,44	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	-1,15	-4,95	-4,95	4,90	11,74	20,00	40,31
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,02	0,15	0,15	0,01	-0,27	-1,24	-1,88
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-0,74	-3,39	-3,39	3,49	9,66	22,62	38,90
% do CDI	-369,78	-697,59	-697,59	363,35	434,57	290,73	266,10
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	-0,90	-2,96	-2,96	-1,32	1,73	14,83	25,69
% do CDI	-447,93	-608,39	-608,39	-137,50	77,70	190,62	175,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,24	0,50	0,50	1,07	2,31	7,23	13,91
% do CDI	119,51	103,23	103,23	111,93	103,88	92,95	95,15
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	0,06	-0,27	-0,27	0,63	2,26		
% do CDI	31,61	-55,92	-55,92	65,18	101,74		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,41	0,14	0,14	0,92	2,55		
% do CDI	202,17	28,69	28,69	95,38	114,78		
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,16	0,42	0,42	0,88	1,93	7,30	13,94
% do CDI	81,46	86,60	86,60	91,23	86,68	93,89	95,39
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	-0,63	-1,61	-1,61	1,38	5,25	14,20	24,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,24	-0,28	-0,28	-0,12	0,27	0,33	0,12
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,91 1,45	3,38 -0,12	3,38 -0,12	33,15 24,84	34,21 21,79	51,63 28,48	229,89 193,44
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	4,07 -1,93	6,58 8,58	6,58 8,58	18,69 -4,60	51,16 -8,57	39,63 17,39	55,47 18,84
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII Var. IFIX p.p.	0,72 2,10	3,11 3,92	3,11 3,92	-25,31 -27,16	-24,24 -38,38	-57,55 -72,21	-61,10 -81,86
FI IMOBILIÁRIO THE ONE Var. IFIX p.p.	-3,74 -2,36	-4,51 -3,70	-4,51 -3,70	-5,87 -7,72	-0,56 -14,70	-1,88 -16,54	-88,70 -109,45
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA Var. IFIX p.p.	0,96 2,34	-3,67 -2,85	-3,67 -2,85	-9,54 -11,39	6,73 -7,41	-7,67 -22,32	-10,11 -30,86
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI Var. SMALL CAP p.p.	3,79 -0,77	-3,30 -2,41	-3,30 -2,41	18,21 -3,25	59,17 -5,41	30,73 -14,14	43,69 -18,23
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,53 -0,46	-2,22 -0,21	-2,22 -0,21	19,75 -3,54	53,04 -6,69	30,10 7,86	61,05 24,42
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	0,16 -5,84	-5,50 -3,49	-5,50 -3,49	14,00 -9,28	51,45 -8,28	10,58 -11,66	25,01 -11,62
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,91 -3,08	-0,00 2,00	-0,00 2,00	25,37 2,08	65,44 5,71	29,81 7,57	49,74 13,11
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	3,58 -2,42	-3,76 -1,75	-3,76 -1,75	13,44 -9,84	41,69 -18,04	0,30 -21,93	19,51 -17,12
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	9,55 4.750,58	-8,53 -1.754,82	-8,53 -1.754,82	8,14 847,57	25,03 1.126,21	13,55 174,19	21,57 147,60
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	2,12 -3,88	1,10 3,10	1,10 3,10	21,26 -2,03	58,11 -1,62	30,49 8,25	51,12 14,50
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,62 -1,95	-2,74 0,47	-2,74 0,47	21,61 0,20	45,22 5,87	27,27 -1,25	47,73 1,59
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,56 -1,00	-1,97 1,24	-1,97 1,24	23,31 1,90	43,07 3,73	6,84 -21,67	20,38 -25,76
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,73 -4,27	-1,46 0,55	-1,46 0,55	10,75 -12,53	64,29 4,56	42,15 19,91	62,62 25,99
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	2,13 -0,19	-4,67 -0,34	-4,67 -0,34	5,38 -0,91	48,20 -2,73	38,89 -1,52	32,97 -6,46
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,25 0,25	-6,34 -4,34	-6,34 -4,34	14,14 -9,15	75,88 16,16		
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-1,18	-6,76	-6,76	11,03	50,86	25,29	47,94

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.	-7,18	-4,76	-4,76	-12,26	-8,86	3,05	11,31
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4,73	-0,93	-0,93	20,40	60,71	38,55	50,22
Var. IBOVESPA p.p.	-1,27	1,07	1,07	-2,89	0,98	16,31	13,60
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3,89	-2,44	-2,44	18,66	56,32	25,45	41,04
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-0,44	-0,44	-4,63	-3,41	3,21	4,41
BB AÇÕES DIVIDENDOS	5,87	-3,57	-3,57	16,25	38,32	8,99	19,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	-1,57	-1,57	-7,04	-21,41	-13,25	-16,88
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3,12	-0,41	-0,41	14,41	52,73	33,63	61,51
Var. IBOVESPA p.p.	-2,88	1,59	1,59	-8,88	-7,00	11,40	24,88
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	5,94	-2,07	-2,07	22,93	58,76	21,62	35,29
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	-0,07	-0,07	-0,35	-0,97	-0,62	-1,34
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	5,98	-2,07	-2,07	23,12	59,23	21,56	35,88
Var. IBOVESPA p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,17	-0,50	-0,68	-0,75
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,43	13,29	13,29	14,78	64,18	108,61	166,72
Var. IBOVESPA p.p.	-2,57	15,30	15,30	-8,51	4,45	86,37	130,09
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,74	9,50	9,50	13,72	68,64	124,01	
Var. IBOVESPA p.p.	-4,26	11,50	11,50	-9,57	8,91	101,77	
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,04	14,59	14,59	19,54	64,44	98,32	
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,51	0,38	0,38	-0,79	-2,36	4,74	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-2,28	-0,17	-0,17	12,32	63,70		
Var. MSCI ACWI p.p.	-7,83	-14,39	-14,39	-8,01	-3,11		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,14	6,58	6,58	9,46	79,75		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,61	3,07	3,07	1,15	67,34		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,61	0,29	0,29	18,05	70,64		
Var. MSCI ACWI p.p.	-7,16	-13,93	-13,93	-2,28	3,83		
BALNEÁRIO CAMBORIÚ	0,97	-0,99	-0,99	7,18	19,15	20,46	29,47
Var. IPCA + 5,42% p.p.	-0,45	-4,36	-4,36	-0,83	7,35	-1,35	-4,76
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

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	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64	27,53	45,49
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76	44,69	79,99
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98	39,93	69,38
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54	45,04	65,50
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19	56,75	97,62
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99	51,70	84,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35	36,70	62,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71	38,15	64,18
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35	45,40	65,85
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40	63,82	131,50
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62	24,23	41,32

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63	79,48	133,01
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14	86,58	142,11
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45	78,91	129,35
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92	116,69	210,83
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75	40,04	91,60
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42	72,50	90,80
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14	77,21	174,91

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	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62	17,69	23,07
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64	17,44	22,80
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60	51,90	59,27
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62	24,25	41,36

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	7,39	15,96	15,96	19,32	68,46	104,94	157,87	202,36	208,78
MSCI ACWI	5,55	14,22	14,22	20,33	66,81	93,57	128,33	169,72	170,64
MSCI World	6,22	14,59	14,59	19,97	66,32	95,04	133,33	172,75	173,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,29	3,03	3,03	7,30	10,31	18,55	28,89	37,53	49,60
IPCA + 5,00%	1,38	3,26	3,26	7,81	11,36	20,84	32,63	42,86	56,89
IPCA + 5,50%	1,42	3,38	3,38	8,06	11,89	21,99	34,53	45,58	60,64
IPCA + 5,89%	1,46	3,48	3,48	8,25	12,30	22,90	36,03	47,73	63,62
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45	48,34	64,47
INPC + 4,00%	1,22	2,93	2,93	7,42	11,18	19,49	30,03	37,24	49,27
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66	48,02	64,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

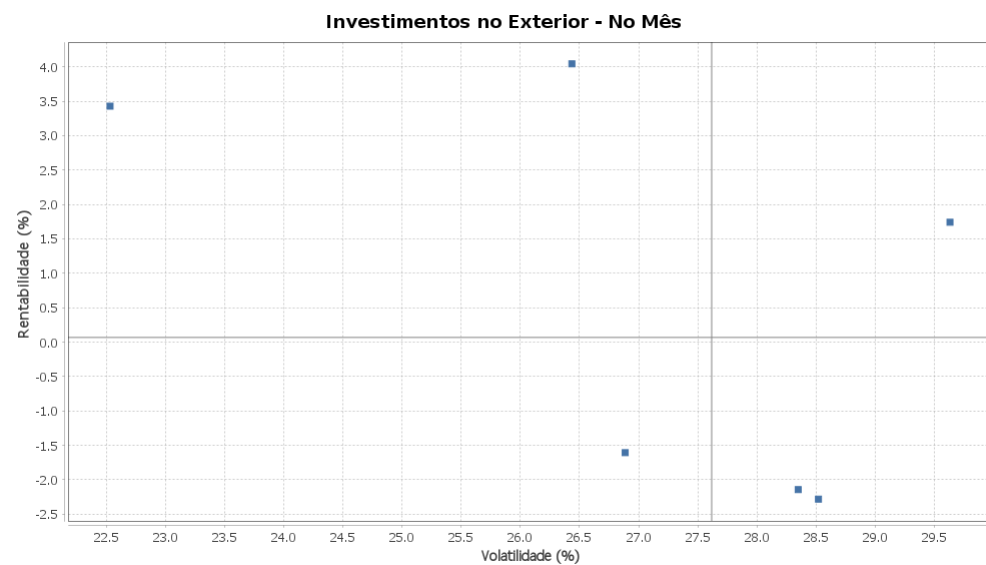
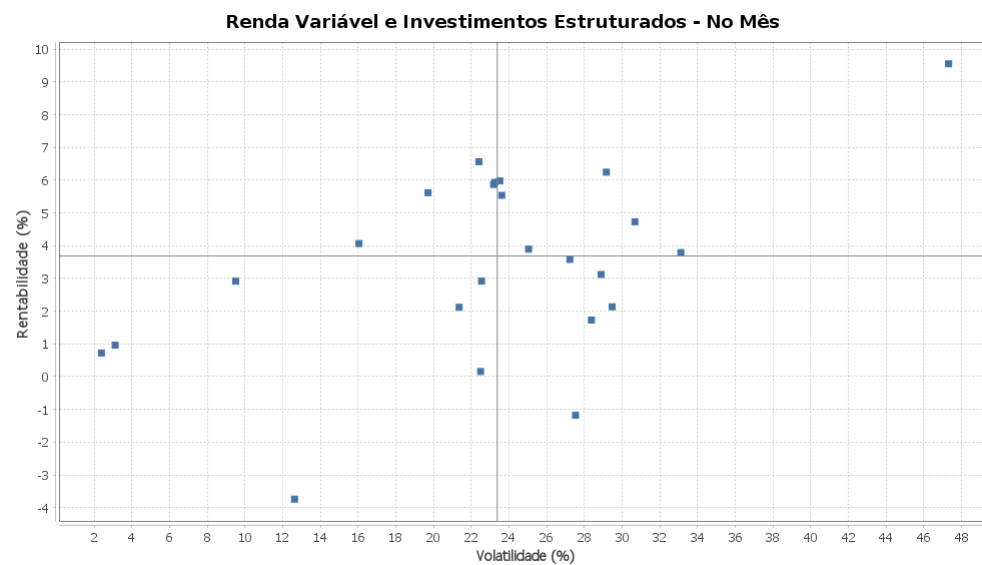
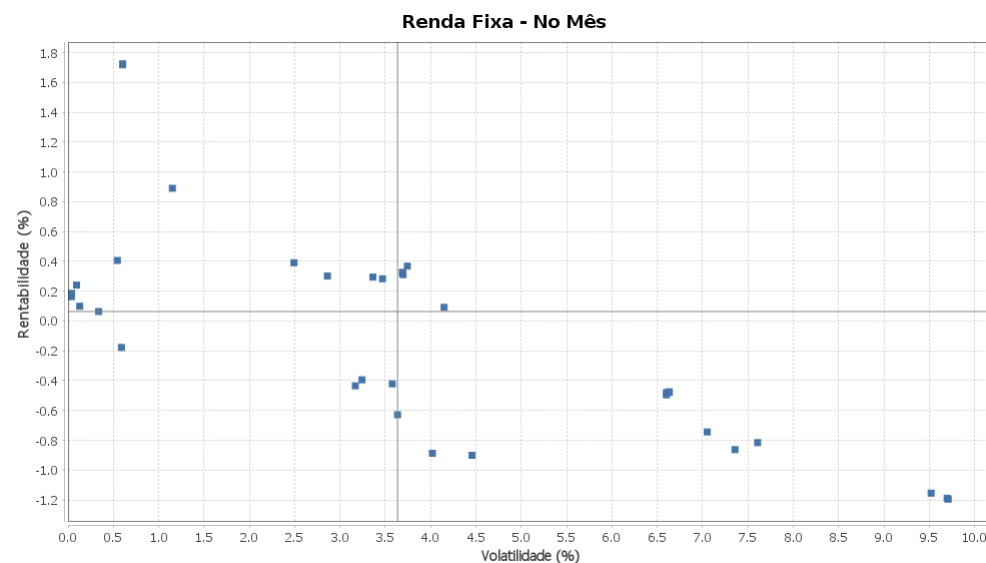
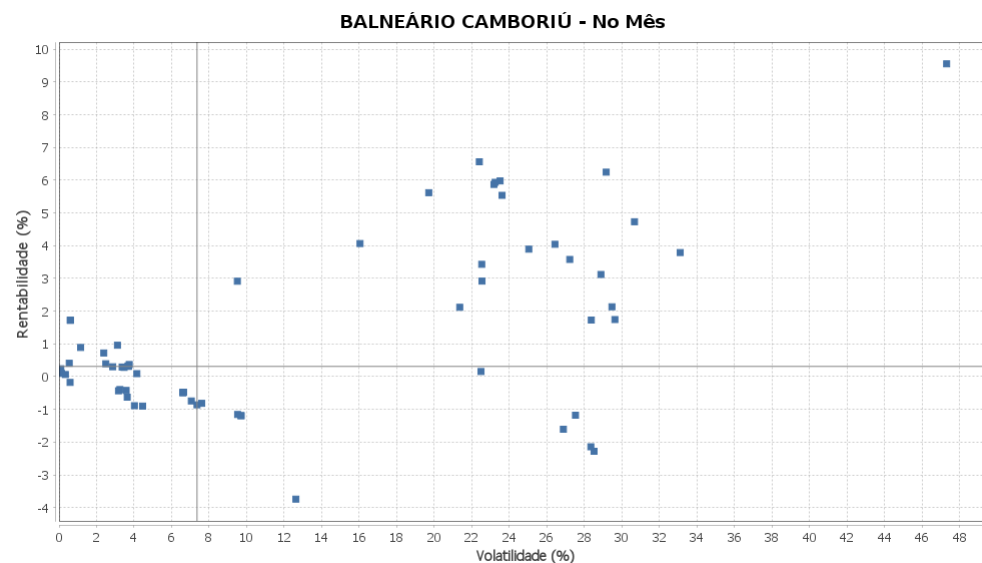
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
68	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	350.000,00	93.365,50044300	3,7487080000
69	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	133.782,85	35.687,72211800	3,7487080000
70	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	560.000,00	149.384,80074300	3,7487080000
82	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	205.000,00	63.930,56329999	3,2066040000
104	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.668,09675500	3,7479900000
89	05/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	43.412,64	0,00	18.800,12432600	2,3091677080
99	10/03/2021	BRABESCO FIA IBOVESPA PLUS	1.000.000,00	0,00	1.114,28854414	897,4336183000
100	10/03/2021	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	1.312.460,05	107.786,69709391	12,1764567000
101	10/03/2021	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	287.539,95	23.614,41896311	12,1764567000
105	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	12.000,00	3.201,53248000	3,7482050000
67	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	500.000,00	0,00	184.211,86427565	2,7142660000
71	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	700.000,00	186.756,06219600	3,7482050000
72	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	800.000,00	213.435,49674600	3,7482050000
83	10/03/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	100.000,00	0,00	3.734,45402805	26,7776760000
84	10/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	600.000,00	12.253,96364155	48,9637490000
85	10/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	100.000,00	2.042,32727359	48,9637490000
88	10/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	433.001,52413500	2,3094606930
90	10/03/2021	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	500.000,00	0,00	145.017,77087000	3,4478533010
91	10/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500.000,00	216.500,76206800	2,3094606930
97	11/03/2021	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	100.000,00	0,00	26.303,99766841	3,8017035000
102	11/03/2021	BRABESCO F I A SELECTION	100.000,00	0,00	106,66385875	937,5246796000
103	11/03/2021	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	500.000,00	0,00	148.956,48534194	3,3566850000
64	11/03/2021	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	100.000,00	0,00	66.670,93360642	1,4999040000
65	11/03/2021	FIA CAIXA CONSUMO	100.000,00	0,00	49.336,52244614	2,0268960000
113	11/03/2021	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	100.000,00	0,00	20.480,46557800	4,8827015000
73	11/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	500.000,00	133.390,53061500	3,7483920000
86	11/03/2021	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	23.730,51025058	21,0699220000
87	11/03/2021	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	100.000,00	0,00	31.896,21736379	3,1351680000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
98	12/03/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	2.324,05467411	215,1412381000
112	12/03/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	517,08342450	966,9619567000
66	12/03/2021	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	500.000,00	0,00	193.391,42811834	2,5854300000
74	12/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	161.599,97	0,00	43.114,41115400	3,7481660000
94	12/03/2021	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	250.000,00	0,00	1.735,83992590	144,0224967000
95	12/03/2021	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	250.000,00	0,00	1.836,32677135	136,1413469000
96	12/03/2021	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	100.000,00	0,00	30.764,75047495	3,2504733000
92	16/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.019.446,67	0,00	874.174,46640000	2,3101185720
106	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.000,00	800,25586300	3,7488010000
93	17/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	192.416,17	0,00	83.284,21719600	2,3103557490
75	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.273.333,25	0,00	1.139.845,81406700	3,7490450000
76	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.592,47	0,00	2.025,17441100	3,7490450000
107	19/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	7.600,00	2.027,13749200	3,7491290000
77	19/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.953.993,56	0,00	521.186,00346900	3,7491290000
108	24/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	81.458,31	21.724,72460100	3,7495670000
78	24/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	18.585,72	4.956,76430700	3,7495670000
79	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.710.929,31	989.441,57324100	3,7505290000
80	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000,00	533,25809200	3,7505290000
109	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	31.140,58	8.302,60035900	3,7507020000
110	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	204.000,00	54.369,75563500	3,7520860000
81	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.144.377,37	304.997,63961800	3,7520860000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 19.073.405,09

Value-At-Risk: 3,17%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,03	0,16	274.859,93	0,05
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-0,39	0,19	11.147.644,61	1,85
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,03	0,00	0,42	0,24	11.545.130,32	1,92
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,04	0,00	-0,79	0,10	14.237.586,21	2,37
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,34	0,30	0,00	-0,41	0,06	1.512.081,55	0,25
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,24	0,00	0,38	0,41	25.169.604,80	4,19
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,59	0,00	-0,00	-0,64	-0,18	1.942.169,27	0,32
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,60	0,15	0,00	2,52	1,72	6.011.772,00	1,00
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,60	0,15	0,00	2,53	1,73	2.992.366,00	0,50
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	1,15	0,30	-0,00	0,60	0,89	11.268.446,32	1,87
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,39	2,08	-0,00	0,22	0,72	67.130,74	0,01
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,49	0,79	0,00	0,08	0,39	278.171,93	0,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,01	0,03	0,30	13.013.186,42	2,16
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	3,11	0,31	0,00	0,24	0,96	551.795,76	0,09
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,13	0,01	-0,20	-0,43	4.485.084,74	0,75
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,12	0,01	-0,18	-0,39	9.706.360,74	1,61
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,36	1,30	0,00	0,03	0,29	864.441,40	0,14
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,47	1,33	0,00	0,02	0,28	3.213.547,60	0,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,58	1,36	0,03	-0,17	-0,42	19.910.273,64	3,31
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,63	1,29	0,00	-0,23	-0,63	3.456.955,44	0,58
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	1,43	0,00	0,03	0,33	3.148.620,40	0,52
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	1,43	0,08	0,03	0,32	50.716.224,85	8,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,43	0,04	0,03	0,31	25.122.078,25	4,18
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	3,74	1,46	0,01	0,04	0,37	6.507.632,03	1,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,02	1,34	0,00	-0,27	-0,89	33.303,94	0,01
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	4,15	1,46	0,01	-0,03	0,09	5.072.358,65	0,84
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	4,46	1,48	0,01	-0,25	-0,90	4.981.758,78	0,83
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,60	2,80	0,01	-0,10	-0,48	3.401.148,99	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,60	2,80	0,01	-0,11	-0,49	2.477.995,98	0,41
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,21	-0,10	-0,47	67.868.768,86	11,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,84	0,14	-0,10	-0,48	45.209.609,66	7,52
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	7,05	2,96	0,04	-0,13	-0,74	12.917.463,81	2,15
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	7,36	3,36	0,09	-0,14	-0,86	24.854.050,72	4,13
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	7,61	3,23	0,00	-0,13	-0,82	1.170.473,09	0,19
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	9,51	1,31	-0,00	0,29	2,91	1.129.542,78	0,19
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	9,52	4,73	0,02	-0,14	-1,15	3.299.488,61	0,55
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	9,70	4,68	0,02	-0,14	-1,19	4.863.602,11	0,81
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	9,71	4,78	0,00	-0,14	-1,20	491.275,91	0,08
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	12,63	0,22	0,00	-0,31	-3,74	1.073.196,00	0,18
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,04	6,68	0,08	0,24	4,07	12.305.428,69	2,05
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,71	10,02	0,04	0,27	5,62	2.604.841,89	0,43
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,36	8,95	0,14	0,09	2,12	10.205.901,60	1,70
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,40	12,02	0,16	0,28	6,56	9.359.067,23	1,56
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	22,49	11,01	0,15	-0,00	0,16	10.156.357,97	1,69
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,53	10,08	0,01	0,14	3,43	9.822.926,16	1,63
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,55	9,68	0,06	0,12	2,91	3.832.803,50	0,64
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	23,18	9,55	0,15	0,24	5,87	10.412.504,71	1,73
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	23,25	10,85	0,25	0,25	5,94	15.424.828,89	2,57
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	23,51	10,92	0,02	0,25	5,98	1.034.072,06	0,17
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,62	11,07	0,05	0,23	5,53	3.165.989,20	0,53
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,04	9,71	0,08	0,15	3,89	4.956.993,12	0,82
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,44	9,60	-0,01	0,15	4,04	2.126.465,44	0,35
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,89	10,48	0,00	-0,07	-1,61	252.359,18	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	27,22	10,22	0,08	0,12	3,58	5.358.743,64	0,89
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,53	10,55	0,00	-0,05	-1,18	289.833,79	0,05
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	28,35	12,73	-0,02	-0,08	-2,14	17.073.271,10	2,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,37	10,10	0,12	0,05	1,73	8.621.720,36	1,43
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	28,52	11,09	0,00	-0,09	-2,28	246.489,80	0,04
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	28,89	10,47	0,33	0,10	3,12	21.693.449,09	3,61
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,17	12,62	0,08	0,21	6,25	4.269.735,03	0,71
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	29,47	10,84	0,05	0,07	2,13	3.390.858,08	0,56
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	29,63	11,60	0,01	0,05	1,74	5.839.839,84	0,97
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	30,68	10,54	0,20	0,15	4,73	12.516.196,75	2,08
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	33,11	11,61	0,31	0,11	3,79	17.690.754,04	2,94
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	47,32	18,47	0,06	0,20	9,55	2.527.517,62	0,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de março 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;