



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
JANEIRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 05.06.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

70,44%

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 TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF | 4,90 | 0,25 | 0,25 | 2.408.611,57 | 0,44 | 196.502.473,72 | 1,23 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC | 1,96 | 0,54 | 0,54 | 2.941.946,84 | 0,54 | 1.663.186.561,29 | 0,18 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI | 4,89 | 0,24 | 0,24 | 3.307.795,95 | 0,60 | 379.812.548,39 | 0,87 |
| BB | BB | BB PREV IMAB TPB | 4,90 | 0,26 | 0,26 | 43.958.061,70 | 8,02 | 6.477.324.446,92 | 0,68 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 4,91 | 0,25 | 0,25 | 67.058.299,39 | 12,24 | 6.604.088.892,56 | 1,02 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | 2,05 | 0,49 | 0,49 | 13.391.600,64 | 2,44 | 1.449.564.546,60 | 0,92 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 1,97 | 0,54 | 0,54 | 11.606.118,41 | 2,12 | 9.706.276.068,00 | 0,12 |
| BB | BB | BB PR IMA GERAL | 2,04 | 0,48 | 0,48 | 4.386.321,28 | 0,80 | 681.675.627,02 | 0,64 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP | 2,10 | 0,84 | 0,84 | 23.929.652,46 | 4,37 | 15.527.608.259,67 | 0,15 |
| BB | BB | BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,97 | 0,56 | 0,56 | 23.307.373,10 | 4,25 | 4.489.872.848,79 | 0,52 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI | 2,63 | 0,69 | 0,69 | 3.216.595,44 | 0,59 | 288.038.368,79 | 1,12 |
| BB | BB | BB PREV RF VII | 1,23 | 0,20 | 0,20 | 798.986,23 | 0,15 | 692.095.869,22 | 0,12 |
| BB | BB | BB PREV ALOC FIC | 2,35 | 0,49 | 0,49 | 63.205.858,38 | 11,53 | 10.446.730.359,40 | 0,61 |
| CEF | CEF | FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | 3,67 | 0,82 | 0,82 | 7.513.379,91 | 1,37 | 10.136.705.212,45 | 0,07 |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF | 5,48 | 0,35 | 0,35 | 1.140.534,01 | 0,21 | 1.727.280.862,91 | 0,07 |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 0,83 | -0,03 | -0,03 | 3.278.818,25 | 0,60 | 1.019.720.781,29 | 0,32 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 1,85 | 0,42 | 0,42 | 1.354.612,58 | 0,25 | 898.056.727,55 | 0,15 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,36 | 1,31 | 1,31 | 5.752.696,00 | 1,05 | 193.466.987,38 | 2,97 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF | 0,36 | 1,32 | 1,32 | 2.867.052,00 | 0,52 | 219.302.580,01 | 1,31 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 3,37 | 0,46 | 0,46 | 285.424.314,14 | 52,08 | | |

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 | 0,04 | 0,36 | 0,36 | 13.658.576,35 | 2,49 | 7.946.016.142,84 | 0,17 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 5,33 | 0,21 | 0,21 | 12.459.984,84 | 2,27 | 334.060.563,28 | 3,73 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,06 | 0,37 | 0,37 | 576.715,58 | 0,11 | 5.345.385.558,02 | 0,01 |
| BRAM | BRABESCO | BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 2,20 | 0,57 | 0,57 | 6.274.695,73 | 1,14 | 943.468.226,26 | 0,67 |
| BB | BB | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,05 | 0,35 | 0,35 | 2.078.454,79 | 0,38 | 2.903.514.199,57 | 0,07 |
| BRAM | BRABESCO | BRABESCO H FI RF NILO | 5,42 | 0,37 | 0,37 | 19.232.648,09 | 3,51 | 874.894.353,92 | 2,20 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,87 | 0,34 | 0,34 | 24.576.817,67 | 4,48 | 5.214.674.759,25 | 0,47 |
| BRAM | BRABESCO | BRABESCO FI RF IDKA PRE 2 | 2,02 | 0,95 | 0,95 | 2.857.810,95 | 0,52 | 683.102.769,53 | 0,42 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC | 1,68 | 0,16 | 0,16 | 10.525.643,42 | 1,92 | 884.500.530,02 | 1,19 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V | 2,77 | 0,66 | 0,66 | 6.352.759,37 | 1,16 | 82.553.366,03 | 7,70 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 2,92 | 0,38 | 0,38 | 98.594.106,79 | 17,99 | | |

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 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | 32,43 | -0,77 | -0,77 | 2.016.902,56 | 0,37 | 113.799.295,33 | 1,77 |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b | | | 32,43 | -0,77 | -0,77 | 2.016.902,56 | 0,37 | | |
| Renda Fixa | | | 3,22 | 0,43 | 0,43 | 386.035.323,49 | 70,44 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,85%

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---------------------------------|---------|---------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------|----------------|---------|
| BRAM | BRDESCO | BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS | 18,06 | -1,53 | -1,53 | 3.938.757,49 | 0,72 | 357.600.714,55 | 1,10 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA | 17,89 | -1,67 | -1,67 | 11.349.115,40 | 2,07 | 574.803.106,30 | 1,97 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 17,40 | -1,67 | -1,67 | 15.287.872,89 | 2,79 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|----------------------------------|-------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------|------------|------------------|---------|
| BRAM | BEM | BRDESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO | 17,40 | -1,16 | -1,16 | 3.953.678,15 | 0,72 | 19.913.543,79 | 19,85 |
| BRAM | BEM | BRDESCO F I A SELECTION | 18,43 | -1,29 | -1,29 | 10.669.442,84 | 1,95 | 971.708.914,14 | 1,10 |
| BB | BB | BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI | 16,76 | 0,38 | 0,38 | 15.975.925,22 | 2,92 | 551.556.764,30 | 2,90 |
| BB | BB | BB Ações Dividendos | 16,73 | -0,42 | -0,42 | 8.525.176,65 | 1,56 | 1.176.739.396,25 | 0,72 |
| BRAM | BRDESCO | BRDESCO FIA DIVIDENDOS | 17,26 | -2,72 | -2,72 | 9.604.970,09 | 1,75 | 2.730.990.987,66 | 0,35 |
| BRAM | BEM | BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL | 15,95 | 1,61 | 1,61 | 22.450.666,07 | 4,10 | 2.245.635.949,92 | 1,00 |
| ITAU | ITAU | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 16,62 | 0,68 | 0,68 | 3.676.983,12 | 0,67 | 889.485.663,39 | 0,41 |
| CEF | CEF | FIA CONSTRUCAO CIVIL | 22,65 | -3,46 | -3,46 | 2.948.124,66 | 0,54 | 1.076.028.516,03 | 0,27 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 16,83 | 2,03 | 2,03 | 7.977.920,06 | 1,46 | 1.987.548.215,87 | 0,40 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 18,79 | -0,58 | -0,58 | 1.803.985,48 | 0,33 | 1.203.119.286,22 | 0,15 |
| NAVI | BEM | NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA | 15,98 | -2,30 | -2,30 | 3.059.880,90 | 0,56 | 1.182.369.995,55 | 0,26 |
| CEF | CEF | FIA CONSUMO | 17,86 | -3,78 | -3,78 | 2.943.254,12 | 0,54 | 957.716.872,27 | 0,31 |
| VINCI | CEF | FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS | 15,73 | 1,53 | 1,53 | 2.411.695,55 | 0,44 | 943.947.729,59 | 0,26 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 16,77 | 0,50 | 0,50 | 13.002.191,55 | 2,37 | 1.590.900.361,63 | 0,82 |
| MOAT | INTRAG | MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | 18,52 | -0,67 | -0,67 | 1.639.472,75 | 0,30 | 3.745.342.274,93 | 0,04 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 16,69 | -0,19 | -0,19 | 10.592.102,55 | 1,93 | 4.585.787.416,19 | 0,23 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 17,86 | 1,47 | 1,47 | 7.172.271,62 | 1,31 | 2.499.126.681,70 | 0,29 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 16,34 | 0,00 | 0,00 | 128.407.741,38 | 23,43 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| 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 MULTIME | 12,40 | 0,37 | 0,37 | 8.582.564,03 | 1,57 | 412.733.691,20 | 2,08 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 12,40 | 0,37 | 0,37 | 8.582.564,03 | 1,57 | | |

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 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE | 65,82 | -0,59 | -0,59 | 920.636,41 | 0,17 | 20.384.112,51 | 4,52 |
| CEF | CEF | FIP CAIXA CYRELA | 23,73 | 4,86 | 4,86 | 2.800.688,64 | 0,51 | 139.180.433,62 | 2,01 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a | | | 24,64 | 3,45 | 3,45 | 3.721.325,05 | 0,68 | | |

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 | FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE | 21,54 | -9,84 | -9,84 | 1.288.200,00 | 0,24 | 154.414.500,00 | 0,83 |
| RIO BRAVO | RIO BRAVO | FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA | 41,16 | -22,41 | -22,41 | 722.146,50 | 0,13 | 623.611.527,00 | 0,12 |
| RIO BRAVO | RIO BRAVO | RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII | 51,41 | -33,40 | -33,69 | 90.172,87 | 0,02 | 15.505.444,10 | 0,58 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b | | | 33,10 | -15,81 | -15,81 | 2.100.519,37 | 0,38 | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 14,40 | -0,27 | -0,27 | 158.100.022,72 | 28,85 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,71%

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 | 14,56 | 6,52 | 6,52 | 3.881.404,95 | 0,71 | 797.257.804,89 | 0,49 |
| Sub-total Artigo 9º A, III | | | 14,56 | 6,52 | 6,52 | 3.881.404,95 | 0,71 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 14,56 | 6,52 | 6,52 | 3.881.404,95 | 0,71 | | |
| Total | | | | | | 548.016.751,16 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| | | | | Política de Investimentos | | | Pró-Gestão Nível 1 |
|---|---|----------------|------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|
| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 285.424.314,14 | 52,08 | 0,00 | 47,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 98.594.106,79 | 17,99 | 0,00 | 12,00 | 40,00 | 45,00 |
| Artigo 7º VII, Alínea b | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado" | 2.016.902,56 | 0,37 | 0,00 | 0,50 | 5,00 | 10,00 |
| | Total Renda Fixa | 386.035.323,49 | 70,44 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 15.287.872,89 | 2,79 | 0,00 | 5,00 | 30,00 | 35,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 128.407.741,38 | 23,43 | 0,00 | 25,00 | 25,00 | 25,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 8.582.564,03 | 1,57 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 10,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea a | Fundos de Participações | 3.721.325,05 | 0,68 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 5,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea b | Fundos de Investimentos Imobiliários | 2.100.519,37 | 0,38 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 5,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 158.100.022,72 | 28,85 | | | | |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | |
| Artigo 9º A, III | Ações - BDR Nível I | 3.881.404,95 | 0,71 | 0,00 | 2,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 3.881.404,95 | 0,71 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

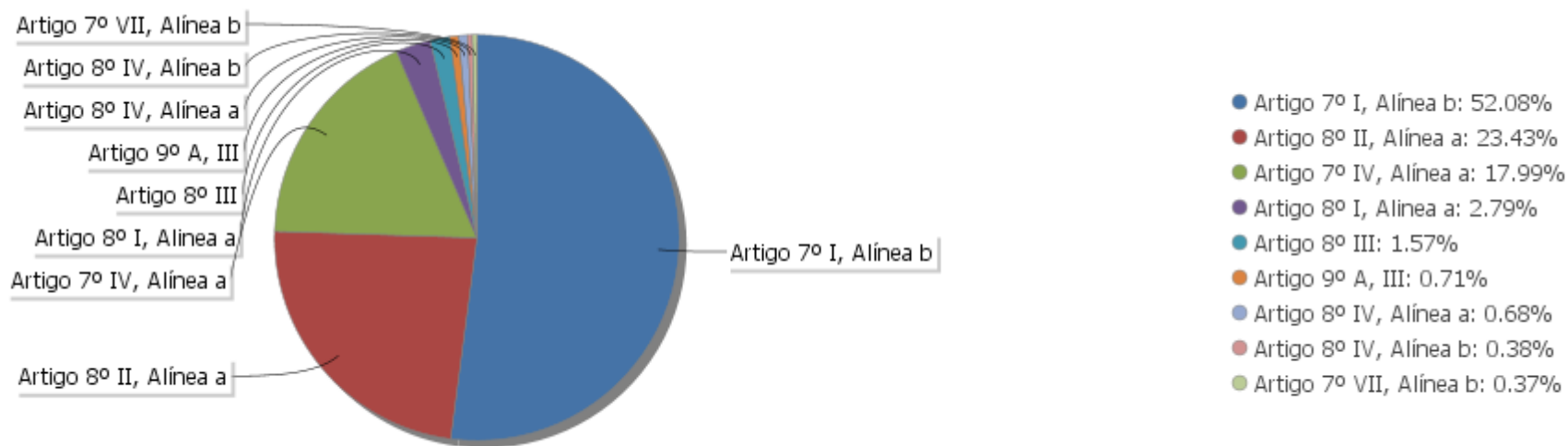
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|------------------|------------------|-------------------|-------------------|-----------------|--------------|--------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,46 121,92 | 0,46 121,92 | 0,09 7,84 | 4,85 186,26 | 14,11 243,92 | 1.320.578,75 | 1.320.578,75 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,38 101,34 | 0,38 101,34 | 0,08 6,85 | 4,26 163,40 | 13,06 225,73 | 477.108,01 | 477.108,01 |
| Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI | -0,77 -205,27 | -0,77 -205,27 | 32,09 2.825,01 | 33,48 1.285,76 | 32,32 558,65 | -16.365,79 | -16.365,79 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -1,67 -0,04 | -1,67 -0,04 | 6,06 -0,04 | 11,54 -0,20 | 22,70 5,89 | -185.810,25 | -185.810,25 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 0,00 1,63 | 0,00 1,63 | 11,02 4,92 | 16,61 4,87 | 26,17 9,37 | -335.257,89 | -335.257,89 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 0,37 2,00 | 0,37 2,00 | 6,91 0,81 | 9,92 -1,81 | 23,14 6,33 | 31.771,02 | 31.771,02 |
| Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 3,45 5,08 | 3,45 5,08 | 8,01 1,91 | -3,94 -15,67 | 2,69 -14,12 | 124.209,81 | 124.209,81 |
| Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | -15,81 -14,18 | -15,81 -14,18 | 9,90 3,80 | 12,74 1,01 | 13,98 -2,83 | -394.391,59 | -394.391,59 |
| Artigo 9º A, III % do CDI | 6,52 1.730,84 | 6,52 1.730,84 | 13,98 1.230,63 | 22,36 858,57 | 42,28 730,99 | 237.534,95 | 237.534,95 |
| | | | | | | 1.259.377,02 | 1.259.377,02 |

Análise de Liquidez

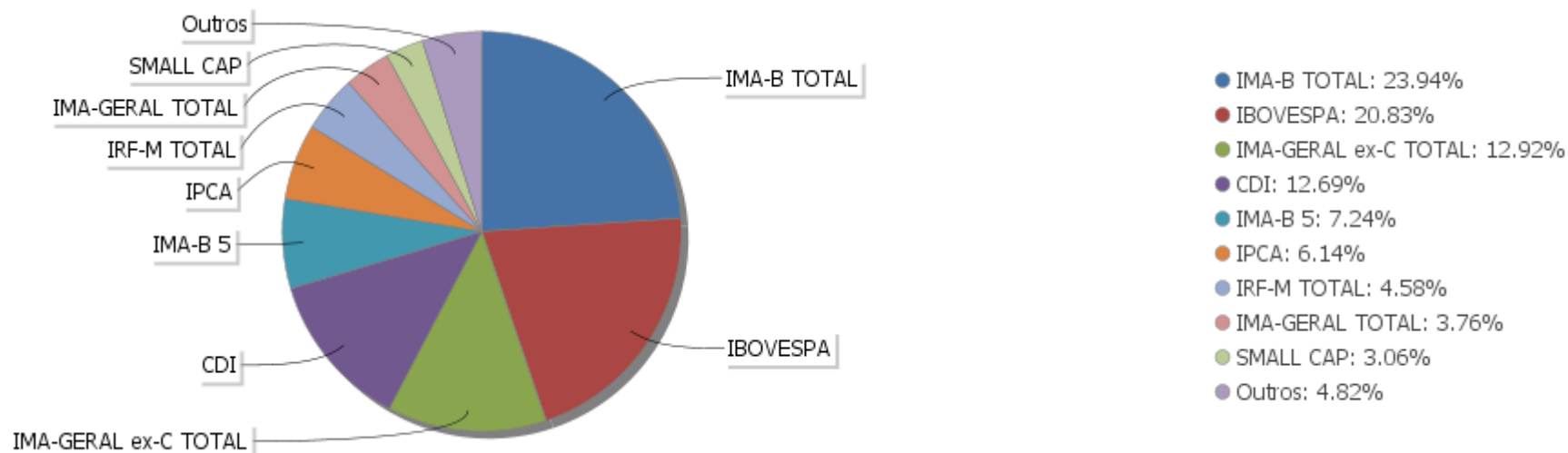
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 502.031.230,51 | 91,61 | 502.031.230,51 | 91,61 |
| de 31 a 364 dias | 29.124.402,79 | 5,31 | 531.155.633,30 | 96,92 |
| acima de 365 dias | 16.861.117,86 | 3,08 | 548.016.751,16 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

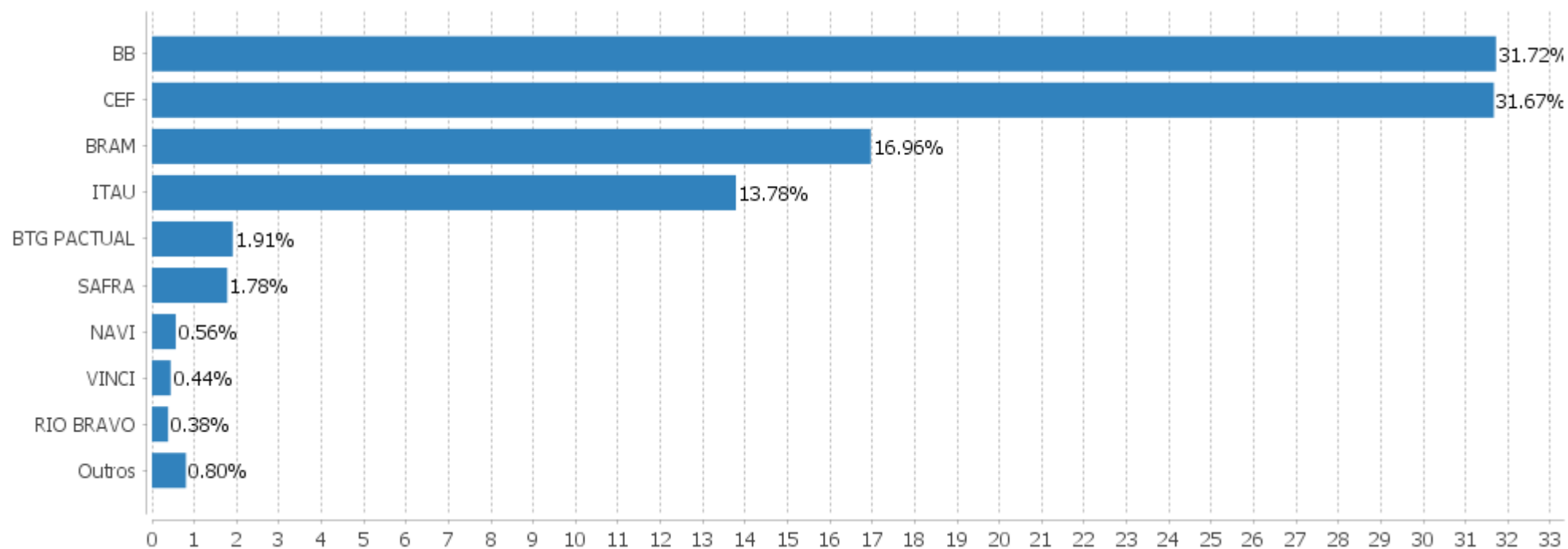


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent.Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|------|-------|------|----------|
| 2020 | 0,22 | | | | | | | | | | | | 0,22 |
| IPCA + 5,87% | 0,71 | | | | | | | | | | | | 0,71 |
| p.p. indexador | -0,49 | | | | | | | | | | | | -0,49 |
| 2019 | 2,76 | 0,29 | 0,45 | 1,18 | 2,10 | 3,07 | 1,36 | 0,18 | 2,07 | 2,37 | -0,59 | 3,02 | 19,76 |
| IPCA + 6% | 0,83 | 0,90 | 1,19 | 1,06 | 0,64 | 0,45 | 0,72 | 0,62 | 0,45 | 0,63 | 0,98 | 1,64 | 10,59 |
| p.p. indexador | 1,92 | -0,61 | -0,75 | 0,12 | 1,45 | 2,62 | 0,64 | -0,44 | 1,63 | 1,74 | -1,57 | 1,38 | 9,17 |
| 2018 | 4,20 | 0,36 | 1,03 | -1,67 | -2,24 | -0,22 | 1,97 | -0,52 | 0,71 | 3,59 | 1,00 | 1,28 | 9,70 |
| IPCA + 6% | 0,80 | 0,74 | 0,58 | 0,71 | 0,89 | 1,75 | 0,84 | 0,44 | 0,92 | 0,96 | 0,25 | 0,61 | 9,92 |
| p.p. indexador | 3,40 | -0,38 | 0,45 | -2,38 | -3,13 | -1,97 | 1,13 | -0,96 | -0,21 | 2,63 | 0,75 | 0,67 | -0,22 |

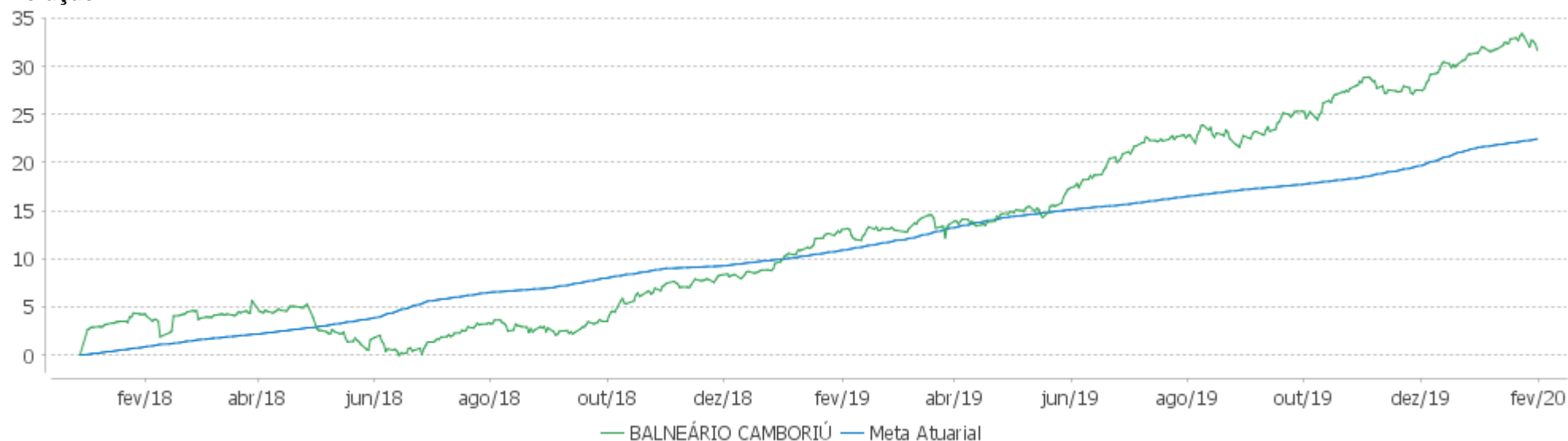
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

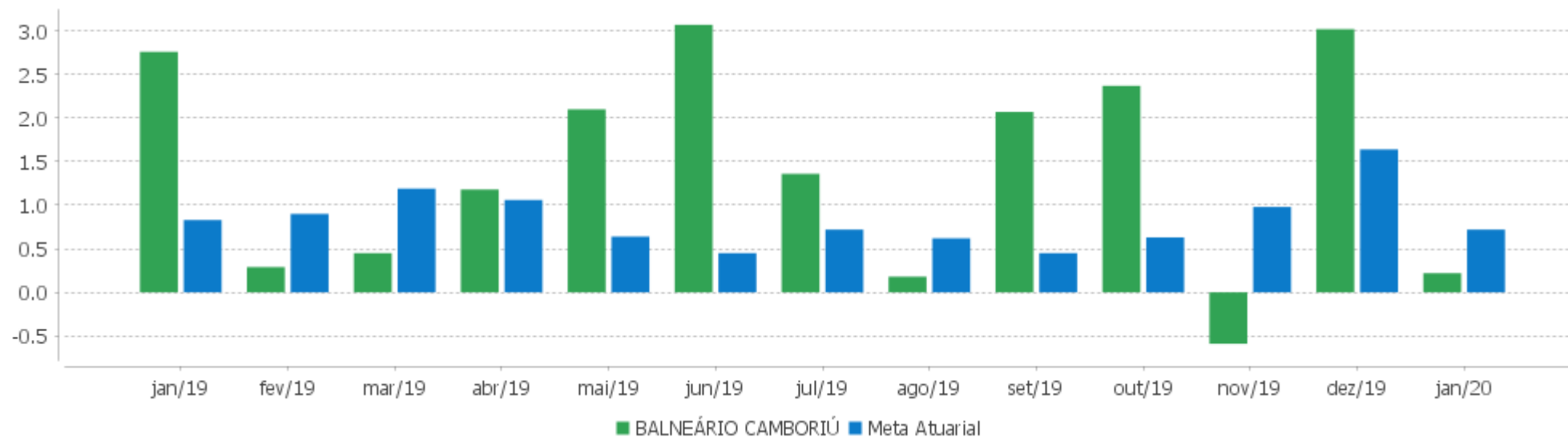
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 14 | 56,00 | 03 meses | 2,64 | 3,36 | -0,72 | 4,41 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 11 | 44,00 | 06 meses | 7,45 | 5,13 | 2,31 | 4,76 |
| | | | 12 meses | 16,81 | 10,46 | 6,35 | 4,63 |
| | | | 24 meses | 26,36 | 21,45 | 4,91 | 4,93 |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,20 | 2018-01 | Desde 29/12/2017 | 31,67 | 22,42 | 9,24 | 5,16 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -2,24 | 2018-05 | | | | | |

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 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI | -0,77 -205,27 | -0,77 -205,27 | 32,09 2.825,01 | 33,48 1.285,76 | 32,32 558,65 | -2,65 -21,14 | -30,00 -129,95 |
| BRADESCO H FI RF NILO % do CDI | 0,37 99,30 | 0,37 99,30 | -0,39 -34,42 | 5,84 224,38 | 19,16 331,27 | 37,05 295,62 | 59,45 257,47 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI | 0,21 54,45 | 0,21 54,45 | -0,59 -52,01 | 5,76 221,33 | 19,42 335,75 | 35,88 286,33 | 54,84 237,54 |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,35 92,89 | 0,35 92,89 | 1,05 92,35 | 2,45 94,13 | 5,55 95,98 | 12,19 97,29 | 22,86 99,00 |
| BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI | 0,95 252,34 | 0,95 252,34 | 1,09 95,62 | 4,49 172,55 | 11,24 194,26 | 24,41 194,74 | 42,22 182,84 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI | 0,36 95,27 | 0,36 95,27 | 1,09 95,95 | 2,52 96,63 | 5,60 96,86 | 12,13 96,81 | 22,62 97,97 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,37 98,46 | 0,37 98,46 | 1,03 91,06 | 2,44 93,73 | 5,55 95,93 | 12,08 96,40 | 22,61 97,91 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6% p.p. | 0,66 -0,06 | 0,66 -0,06 | 1,34 -2,04 | 5,43 0,29 | 13,95 3,48 | 37,27 15,81 | |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI | 0,16 42,02 | 0,16 42,02 | 1,53 134,40 | 4,16 159,56 | 9,83 169,91 | | |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p. | 0,34 0,13 | 0,34 0,13 | 1,04 -0,84 | 2,66 0,60 | 9,69 5,50 | 19,74 11,62 | 34,32 23,11 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 0,57 0,01 | 0,57 0,01 | 0,69 -0,05 | 4,06 -0,07 | 11,37 0,05 | 22,72 0,04 | 38,62 0,28 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,69 0,43 | 0,69 0,43 | 1,38 1,62 | 5,35 -0,29 | 13,63 -4,48 | 26,26 -8,53 | 44,53 -9,79 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,25 -0,01 | 0,25 -0,01 | -0,36 -0,12 | 5,44 -0,20 | 17,72 -0,40 | 34,14 -0,64 | 53,25 -1,07 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p. | 0,54 -0,01 | 0,54 -0,01 | 1,41 -0,10 | 4,89 -0,15 | 11,76 -0,30 | 22,83 -0,53 | 38,27 -0,85 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p. | 0,54 -0,02 | 0,54 -0,02 | 1,46 -0,05 | 4,93 -0,10 | 11,80 -0,26 | 22,57 -0,79 | 37,69 -1,44 |
| BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,56 -0,00 | 0,56 -0,00 | 1,44 -0,07 | 4,92 -0,12 | 11,82 -0,24 | 22,86 -0,50 | 38,36 -0,77 |
| BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF | 0,25 | 0,25 | -0,34 | 5,53 | 17,63 | 33,83 | 52,74 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,01 | -0,01 | -0,11 | -0,11 | -0,48 | -0,95 | -1,58 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 0,42 | 0,42 | 1,47 | 4,59 | 11,28 | 32,08 | 44,58 |
| Var. INPC + 6% p.p. | -0,28 | -0,28 | -1,98 | -0,57 | 0,69 | 10,73 | 13,63 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP | 0,84 | 0,84 | 0,96 | 4,33 | 11,12 | 22,99 | 39,91 |
| Var. IRF-M TOTAL p.p. | -0,04 | -0,04 | -0,08 | -0,17 | -0,35 | -0,54 | -1,04 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | 0,49 | 0,49 | 0,64 | 3,96 | 10,78 | 21,70 | 36,92 |
| Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | -0,07 | -0,07 | -0,09 | -0,18 | -0,55 | -0,98 | -1,42 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | -0,03 | -0,03 | 1,62 | 3,33 | 7,50 | 17,30 | 25,73 |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,30 | -0,30 | 1,86 | -2,31 | -10,62 | -17,48 | -28,59 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1,31 | 1,31 | 3,42 | 5,24 | 10,68 | 21,76 | 25,54 |
| Var. IPCA + 6% p.p. | 0,59 | 0,59 | 0,05 | 0,10 | 0,21 | 0,30 | -6,80 |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI | 0,24 | 0,24 | -0,29 | 5,52 | 17,77 | 33,68 | 52,36 |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,02 | -0,02 | -0,05 | -0,13 | -0,34 | -1,10 | -1,96 |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF | 0,35 | 0,35 | 0,04 | 6,13 | 18,32 | | |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,09 | 0,09 | 0,28 | 0,49 | 0,20 | | |
| BB PREV RF VII | 0,20 | 0,20 | 1,55 | 3,91 | 9,21 | 20,11 | 34,75 |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,06 | -0,06 | 1,79 | -1,73 | -8,90 | -14,67 | -19,57 |
| BB PREV ALOC FIC | 0,49 | 0,49 | 0,50 | 3,93 | 11,38 | 22,76 | 37,70 |
| Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | -0,01 | -0,01 | -0,21 | -0,15 | 0,31 | 0,53 | -0,16 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | 0,82 | 0,82 | 0,91 | 4,67 | 14,10 | 25,30 | 39,15 |
| Var. IPCA p.p. | 0,61 | 0,61 | -0,97 | 2,62 | 9,91 | 17,17 | 27,94 |
| BB PREV IMAB TPB | 0,26 | 0,26 | -0,30 | 5,54 | 17,83 | 34,11 | 53,19 |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,00 | -0,00 | -0,06 | -0,10 | -0,29 | -0,67 | -1,13 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF | 1,32 | 1,32 | 3,44 | 5,28 | 10,76 | 21,95 | 25,66 |
| Var. INPC + 6% p.p. | 0,62 | 0,62 | -0,02 | 0,11 | 0,17 | 0,60 | -5,29 |
| BB PR IMA GERAL | 0,48 | 0,48 | 0,65 | 3,96 | 10,81 | 21,69 | 36,90 |
| Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | -0,02 | -0,02 | -0,06 | -0,11 | -0,26 | -0,54 | -0,96 |
| BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI | 0,38 | 0,38 | 17,66 | 22,75 | 39,92 | 57,63 | 110,64 |
| Var. SMALL CAP p.p. | -0,08 | -0,08 | -1,32 | -2,07 | -5,33 | -7,07 | -19,69 |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA | -2,30 | -2,30 | 6,69 | 15,24 | 22,87 | 63,81 | 115,18 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,67 | -0,67 | 0,59 | 3,50 | 6,07 | 29,84 | 39,27 |
| BRADESCO F I A SELECTION | -1,29 | -1,29 | 4,28 | 11,26 | 18,91 | 40,76 | 94,56 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,34 | 0,34 | -1,82 | -0,48 | 2,11 | 6,78 | 18,65 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 1,47 | 1,47 | 15,18 | 17,48 | 31,03 | 65,96 | 116,32 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 3,10 | 3,10 | 9,08 | 5,75 | 14,23 | 31,99 | 40,41 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | -0,58 | -0,58 | 8,52 | 14,85 | 21,02 | 46,04 | 88,90 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|------------------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,05 | 1,05 | 2,42 | 3,12 | 4,21 | 12,07 | 12,99 |
| FIA CONSTRUCAO CIVIL % do CDI | 3,64 966,99 | 3,64 966,99 | 23,54 2.072,47 | 29,52 1.133,42 | 57,52 994,31 | 75,63 603,46 | 106,96 463,25 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | -0,19 | -0,19 | 9,98 | 18,27 | 31,46 | 59,14 | |
| FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 1,53 3,11 | 1,53 3,11 | 10,76 -0,03 | 17,94 0,79 | 28,52 1,51 | 51,11 0,35 | 95,52 4,37 |
| BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO Var. IBRX 100 p.p. | -0,13 1,13 | -0,13 1,13 | 7,79 0,84 | 14,41 1,77 | 22,90 3,93 | 44,98 7,70 | 93,09 12,22 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | 2,03 3,66 | 2,03 3,66 | 9,64 3,54 | 15,80 4,06 | 32,00 15,19 | 59,43 25,46 | 114,38 38,47 |
| BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -2,72 -1,13 | -2,72 -1,13 | 4,27 -6,52 | 7,15 -10,00 | 10,99 -16,02 | 30,89 -19,87 | 72,69 -18,46 |
| FIA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p. | 3,38 -0,28 | 3,38 -0,28 | 15,59 0,26 | 21,53 0,29 | 42,76 -0,53 | 38,33 -5,24 | 80,91 -6,66 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p. | 0,50 2,13 | 0,50 2,13 | 18,51 12,41 | 24,23 12,50 | 41,26 24,46 | 56,18 22,21 | 119,71 43,80 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p. | 0,68 2,31 | 0,68 2,31 | 10,42 4,32 | 16,16 4,43 | 23,73 6,93 | 43,87 9,90 | 86,45 10,54 |
| BB Ações Dividendos Var. IBOVESPA p.p. | -0,42 1,21 | -0,42 1,21 | 7,87 1,77 | 11,61 -0,12 | 18,23 1,43 | 36,18 2,20 | 68,85 -7,06 |
| MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | -0,67 | -0,67 | 12,83 | 15,96 | 27,04 | 70,19 | |
| BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p. | 1,61 3,24 | 1,61 3,24 | 15,57 9,47 | 21,71 9,97 | 35,76 18,96 | 71,51 37,54 | 134,27 58,36 |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p. | -1,67 -0,04 | -1,67 -0,04 | 6,08 -0,02 | 11,55 -0,18 | 16,45 -0,36 | 32,88 -1,09 | 73,28 -2,63 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p. | -1,67 -0,04 | -1,67 -0,04 | 6,10 -0,00 | 11,61 -0,13 | 16,54 -0,27 | 33,71 -0,27 | 74,86 -1,05 |
| RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII Var. IFIX p.p. | -33,69 -29,93 | -33,69 -29,93 | -46,53 -56,75 | -41,11 -56,82 | -38,17 -65,87 | -49,28 -83,94 | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE Var. IFIX p.p. | -9,84 -6,08 | -9,84 -6,08 | 13,30 3,08 | 14,99 -0,71 | 15,47 -12,23 | -85,88 -120,53 | |
| FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA Var. IFIX p.p. | -22,41 -18,65 | -22,41 -18,65 | 19,03 8,82 | 22,23 6,52 | 23,96 -3,74 | 18,36 -16,30 | |
| GÁVEA INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE Var. IPCA + 6% p.p. | -0,59 -1,31 | -0,59 -1,31 | 19,53 16,15 | 15,50 10,36 | 14,28 3,81 | 151,93 130,47 | 177,52 145,19 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|--------------|--------------|---------------|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| FIP CAIXA CYRELA Var. IBOVESPA p.p. | 4,86 6,49 | 4,86 6,49 | 4,81 -1,29 | -12,11 -23,84 | -3,09 -19,89 | -3,67 -37,65 | |
| SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME Var. IBOVESPA p.p. | 0,37 2,00 | 0,37 2,00 | 6,91 0,81 | 9,92 -1,81 | 23,14 6,33 | 22,42 -11,55 | 64,49 -11,42 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p. | 6,52 8,15 | 6,52 8,15 | 13,98 7,88 | 22,36 10,62 | 42,28 25,48 | 55,39 21,41 | 99,23 23,32 |
| CDI | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,53 | 23,09 |
| IBOVESPA | -1,63 | -1,63 | 6,10 | 11,74 | 16,80 | 33,97 | 75,91 |
| INPC + 6% | 0,70 | 0,70 | 3,46 | 5,16 | 10,59 | 21,35 | 30,95 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,72 | 3,37 | 5,14 | 10,47 | 21,46 | 32,33 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Renda Fixa | | | | | | | |
| IRF-M 1 | 0,44 | 0,44 | 1,20 | 3,05 | 6,61 | 14,04 | 25,84 |
| IRF-M 1+ | 1,11 | 1,11 | 0,99 | 5,27 | 13,57 | 27,70 | 47,38 |
| IRF-M TOTAL | 0,88 | 0,88 | 1,04 | 4,50 | 11,47 | 23,54 | 40,94 |
| IMA-B 5 | 0,56 | 0,56 | 1,51 | 5,04 | 12,06 | 23,36 | 39,12 |
| IMA-B 5+ | 0,03 | 0,03 | -1,54 | 6,07 | 22,33 | 43,41 | 65,98 |
| IMA-B TOTAL | 0,26 | 0,26 | -0,24 | 5,64 | 18,11 | 34,79 | 54,32 |
| IMA-C TOTAL | 2,54 | 2,54 | 1,76 | 6,14 | 20,05 | 38,88 | 56,63 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,50 | 0,50 | 0,70 | 4,08 | 11,07 | 22,22 | 37,86 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,56 | 0,56 | 0,73 | 4,13 | 11,32 | 22,68 | 38,34 |
| IDKA 2 | 0,54 | 0,54 | 1,76 | 4,74 | 11,02 | 22,45 | 38,67 |
| IDKA 20 | -1,37 | -1,37 | -3,65 | 5,34 | 28,11 | 57,81 | 85,76 |
| CDI | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,53 | 23,09 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | -1,63 | -1,63 | 6,10 | 11,74 | 16,80 | 33,97 | 75,91 |
| IBRX 100 | -1,25 | -1,25 | 6,95 | 12,64 | 18,97 | 37,28 | 80,87 |
| IBRX 50 | -1,88 | -1,88 | 5,44 | 10,57 | 14,75 | 29,92 | 71,82 |
| SMALL CAP | 0,45 | 0,45 | 18,98 | 24,82 | 45,25 | 64,69 | 130,34 |
| IFIX | -3,76 | -3,76 | 10,22 | 15,71 | 27,70 | 34,66 | 59,06 |
| Índice Consumo - ICON | 3,66 | 3,66 | 15,32 | 21,23 | 43,29 | 43,57 | 87,57 |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,58 | -1,58 | 10,79 | 17,15 | 27,01 | 50,76 | 91,15 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,21 | 0,21 | 1,88 | 2,05 | 4,19 | 8,13 | 11,21 |
| INPC | 0,19 | 0,19 | 1,96 | 2,07 | 4,30 | 8,03 | 10,05 |
| IGPM | 0,48 | 0,48 | 2,89 | 2,88 | 7,82 | 15,10 | 14,63 |
| SELIC | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,54 | 23,11 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |
| IPCA + 4% | 0,55 | 0,55 | 2,88 | 4,12 | 8,38 | 16,93 | 25,02 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IPCA + 5% | 0,64 | 0,64 | 3,13 | 4,63 | 9,42 | 19,19 | 28,64 |
| IPCA + 5,5% | 0,68 | 0,68 | 3,25 | 4,89 | 9,95 | 20,32 | 30,48 |
| IPCA + 5,89% | 0,71 | 0,71 | 3,35 | 5,09 | 10,35 | 21,21 | 31,93 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,72 | 3,37 | 5,14 | 10,47 | 21,46 | 32,33 |
| INPC + 4% | 0,53 | 0,53 | 2,96 | 4,14 | 8,49 | 16,82 | 23,71 |
| INPC + 6% | 0,70 | 0,70 | 3,46 | 5,16 | 10,59 | 21,35 | 30,95 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|---|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| 02/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 18.000,00 | 0,00 | 5.173,19423189 | 3,4794750000 |
| 08/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 113.842,09 | 31.153,09203266 | 3,6542790000 |
| 09/01/2020 | BRASESCO FIA DIVIDENDOS | 0,00 | 6.500.000,00 | 527.704,57545603 | 12,3174979000 |
| 10/01/2020 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 45.291,31 | 0,00 | 20.125,63068400 | 2,2504290000 |
| 13/01/2020 | BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA | 6.500.000,00 | 0,00 | 547.495,99799377 | 11,8722329000 |
| 15/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 7.466,67 | 2.142,34498874 | 3,4852790000 |
| 17/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 3.422.067,74 | 0,00 | 935.299,88586397 | 3,6587920000 |
| 20/01/2020 | BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | 100.000,00 | 0,00 | 5.203,35103700 | 19,2183840000 |
| 20/01/2020 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 93.131,31 | 0,00 | 41.343,25012400 | 2,2526363970 |
| 20/01/2020 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 100.000,00 | 44.392,42841600 | 2,2526363970 |
| 20/01/2020 | BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2.911.500,00 | 0,00 | 151.495,56544700 | 19,2183843230 |
| 20/01/2020 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 3.000.000,00 | 1.331.772,85246500 | 2,2526363970 |
| 20/01/2020 | BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | 13.900.000,00 | 0,00 | 723.265,79416700 | 19,2183843230 |
| 20/01/2020 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 13.900.000,00 | 6.170.547,54975600 | 2,2526363970 |
| 20/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 18.000.000,00 | 0,00 | 5.176.179,91021053 | 3,4774680000 |
| 20/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 28.000.000,00 | 7.651.531,75467659 | 3,6593980000 |
| 21/01/2020 | BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | 88.500,00 | 0,00 | 4.606,26015700 | 19,2129834120 |
| 21/01/2020 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.900.339,78 | 0,00 | 843.471,69294300 | 2,2529976950 |
| 21/01/2020 | FIA CONSUMO | 1.500.000,00 | 0,00 | 654.636,77042369 | 2,2913470000 |
| 21/01/2020 | FIA CONSTRUCAO CIVIL | 1.500.000,00 | 0,00 | 603.131,45853270 | 2,4870200000 |
| 21/01/2020 | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 7.000.000,00 | 0,00 | 3.283.152,68958213 | 2,1320970000 |
| 24/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 143.000,00 | 40.957,50043535 | 3,4914240000 |
| 24/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 141.000,00 | 38.506,56782768 | 3,6617130000 |
| 27/01/2020 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 108,08 | 47,94488000 | 2,2542552820 |
| 27/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 1.557,28 | 446,56442362 | 3,4872460000 |
| 27/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 410,84 | 117,81216467 | 3,4872460000 |
| 28/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 5.918,43 | 1.694,18879358 | 3,4933710000 |
| 29/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 3.300.085,69 | 900.790,27007994 | 3,6635450000 |

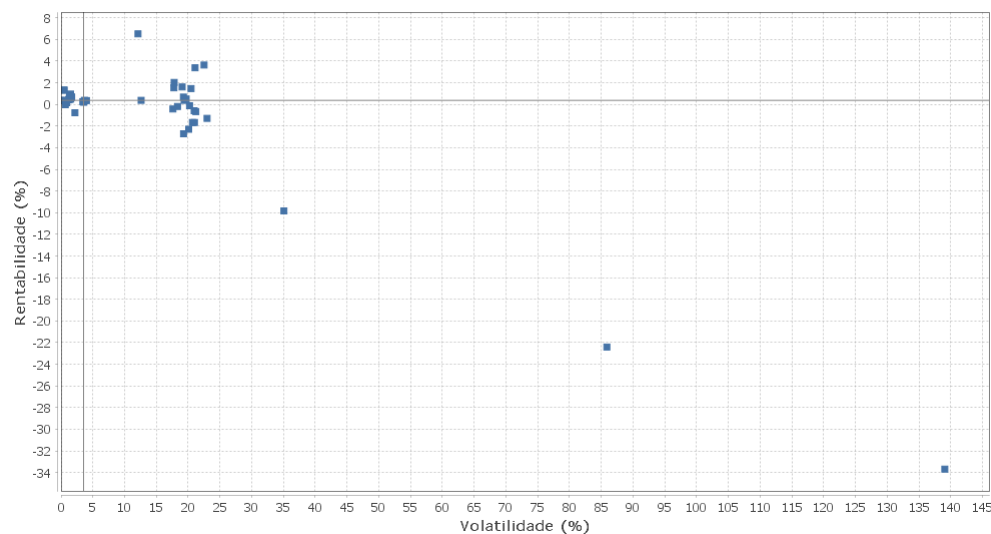
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|---|--------------|--------------|--------------------|----------------|
| 29/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 2.423,28 | 661,45768648 | 3,6635450000 |
| 30/01/2020 | BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | 4.000.000,00 | 0,00 | 4.336,59727953 | 922,3821679000 |
| 30/01/2020 | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA | 0,00 | 8.000.000,00 | 672.414,09815338 | 11,8974305000 |
| 30/01/2020 | BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO | 4.000.000,00 | 0,00 | 155.819,41192391 | 25,6707425000 |
| 30/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP | 0,00 | 3.000.000,00 | 1.344.382,36385440 | 2,2315080000 |
| 30/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 4.000.000,00 | 1.144.008,01492015 | 3,4964790000 |
| 30/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 3.000.000,00 | 858.006,01119011 | 3,4964790000 |
| 30/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 28.171,36 | 8.057,06540780 | 3,4964790000 |
| 31/01/2020 | FIA CONSUMO | 1.500.000,00 | 0,00 | 680.375,78515366 | 2,2046640000 |
| 31/01/2020 | FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA | 4.000.000,00 | 0,00 | 1.550.036,13521740 | 2,5805850000 |
| 31/01/2020 | FIA CONSTRUCAO CIVIL | 1.500.000,00 | 0,00 | 624.737,08980804 | 2,4010100000 |
| 31/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 2.000,00 | 572,81822845 | 3,4915090000 |
| 31/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 18.000,00 | 4.911,64362424 | 3,6647610000 |
| 31/01/2020 | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 1.500.000,00 | 0,00 | 321.425,05641599 | 4,6667177000 |

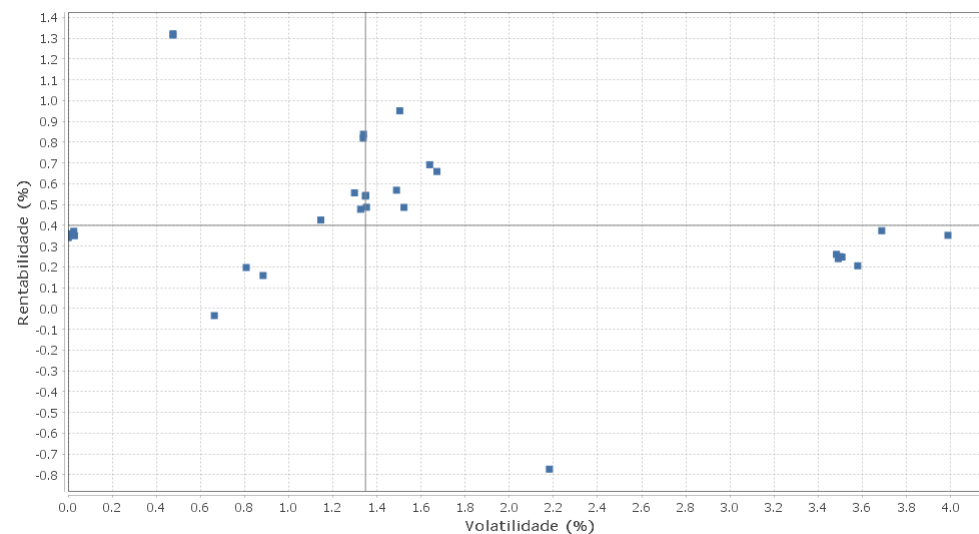
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

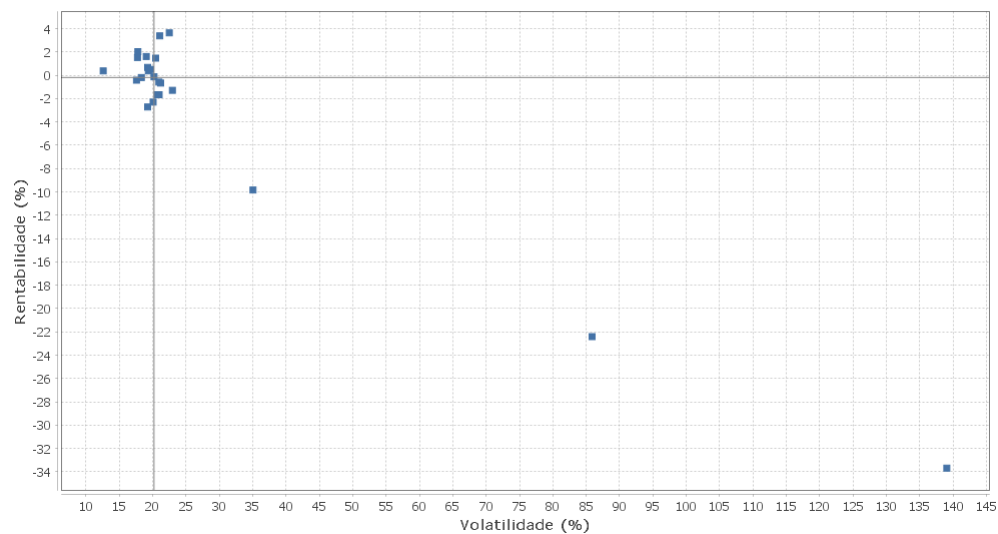
BALNEÁRIO CAMBORIÚ - No Mês



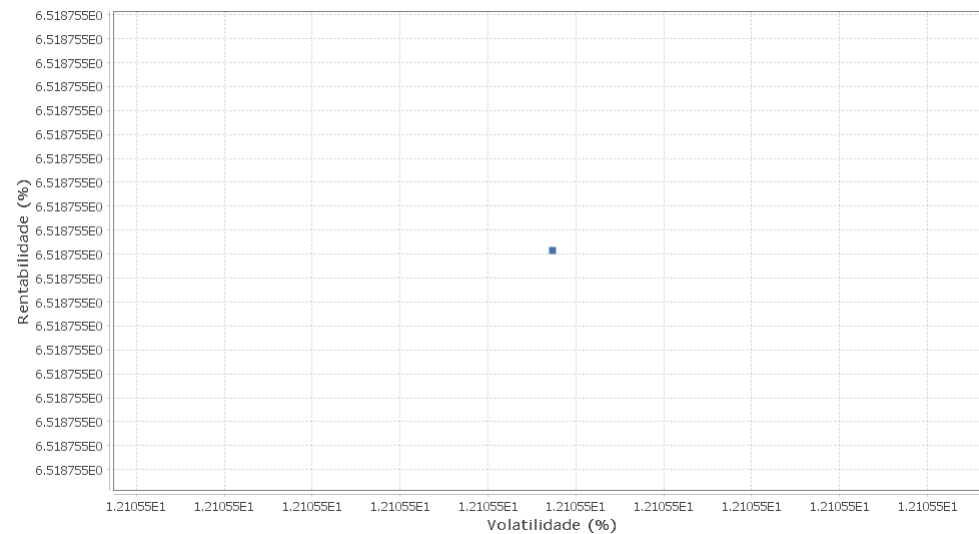
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-------------------------|--------------|------|-------|---------------|------------|
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,00 | 0,02 | 0,34 | 24.576.817,67 | 4,48 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,00 | 0,02 | 0,36 | 13.658.576,35 | 2,49 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,02 | 0,37 | 576.715,58 | 0,11 |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,02 | 0,35 | 2.078.454,79 | 0,38 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,48 | 0,11 | 1,32 | 2.867.052,00 | 0,52 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,48 | 0,11 | 1,31 | 5.752.696,00 | 1,05 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | Artigo 7º I, Alínea b | 0,66 | 0,07 | -0,03 | 3.278.818,25 | 0,60 |
| BB PREV RF VII | Artigo 7º I, Alínea b | 0,81 | 0,09 | 0,20 | 798.986,23 | 0,15 |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,88 | 0,10 | 0,16 | 10.525.643,42 | 1,92 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,15 | 0,14 | 0,42 | 1.354.612,58 | 0,25 |
| BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,30 | 0,16 | 0,56 | 23.307.373,10 | 4,25 |
| BB PR IMA GERAL | Artigo 7º I, Alínea b | 1,33 | 0,16 | 0,48 | 4.386.321,28 | 0,80 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 1,34 | 0,18 | 0,82 | 7.513.379,91 | 1,37 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,34 | 0,18 | 0,84 | 23.929.652,46 | 4,37 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC | Artigo 7º I, Alínea b | 1,35 | 0,16 | 0,54 | 2.941.946,84 | 0,54 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b | 1,35 | 0,16 | 0,54 | 11.606.118,41 | 2,12 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,35 | 0,16 | 0,49 | 13.391.600,64 | 2,44 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,49 | 0,18 | 0,57 | 6.274.695,73 | 1,14 |
| BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,50 | 0,20 | 0,95 | 2.857.810,95 | 0,52 |
| BB PREV ALOC FIC | Artigo 7º I, Alínea b | 1,52 | 0,18 | 0,49 | 63.205.858,38 | 11,53 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,64 | 0,20 | 0,69 | 3.216.595,44 | 0,59 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,67 | 0,20 | 0,66 | 6.352.759,37 | 1,16 |
| PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | Artigo 7º VII, Alínea b | 2,18 | 0,19 | -0,77 | 2.016.902,56 | 0,37 |
| BB PREV IMAB TPB | Artigo 7º I, Alínea b | 3,48 | 0,37 | 0,26 | 43.958.061,70 | 8,02 |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI | Artigo 7º I, Alínea b | 3,49 | 0,37 | 0,24 | 3.307.795,95 | 0,60 |
| BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF | Artigo 7º I, Alínea b | 3,50 | 0,37 | 0,25 | 2.408.611,57 | 0,44 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b | 3,51 | 0,37 | 0,25 | 67.058.299,39 | 12,24 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | Artigo 7º IV, Alínea a | 3,58 | 0,38 | 0,21 | 12.459.984,84 | 2,27 |
| BRADESCO H FI RF NILO | Artigo 7º IV, Alínea a | 3,69 | 0,40 | 0,37 | 19.232.648,09 | 3,51 |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF | Artigo 7º I, Alínea b | 3,99 | 0,43 | 0,35 | 1.140.534,01 | 0,21 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|------------------------|--------------|-------|--------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | Artigo 9º A, III | 12,11 | 1,54 | 6,52 | 3.881.404,95 | 0,71 |
| SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME | Artigo 8º III | 12,60 | 1,32 | 0,37 | 8.582.564,03 | 1,57 |
| BB Ações Dividendos | Artigo 8º II, Alínea a | 17,60 | 1,80 | -0,42 | 8.525.176,65 | 1,56 |
| FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 17,75 | 1,91 | 1,53 | 2.411.695,55 | 0,44 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 17,79 | 1,93 | 2,03 | 7.977.920,06 | 1,46 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | Artigo 8º II, Alínea a | 18,33 | 1,89 | -0,19 | 10.592.102,55 | 1,93 |
| BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL | Artigo 8º II, Alínea a | 19,05 | 2,05 | 1,61 | 22.450.666,07 | 4,10 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | Artigo 8º II, Alínea a | 19,25 | 2,03 | 0,68 | 3.676.983,12 | 0,67 |
| BRADERCO FIA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 19,27 | 1,87 | -2,72 | 9.604.970,09 | 1,75 |
| BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI | Artigo 8º II, Alínea a | 19,37 | 2,02 | 0,38 | 15.975.925,22 | 2,92 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 19,70 | 2,06 | 0,50 | 13.002.191,55 | 2,37 |
| NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 20,08 | 1,97 | -2,30 | 3.059.880,90 | 0,56 |
| BRADERCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 20,21 | 2,09 | -0,13 | 3.953.678,15 | 0,72 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | Artigo 8º II, Alínea a | 20,46 | 2,19 | 1,47 | 7.172.271,62 | 1,31 |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA | Artigo 8º I, Alínea a | 20,68 | 2,07 | -1,67 | 11.349.115,40 | 2,07 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 20,95 | 2,14 | -0,58 | 1.803.985,48 | 0,33 |
| BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS | Artigo 8º I, Alínea a | 20,99 | 2,10 | -1,67 | 3.938.757,49 | 0,72 |
| FIA CONSUMO | Artigo 8º II, Alínea a | 21,08 | 2,34 | 3,38 | 2.943.254,12 | 0,54 |
| MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 21,21 | 2,17 | -0,67 | 1.639.472,75 | 0,30 |
| FIA CONSTRUCAO CIVIL | Artigo 8º II, Alínea a | 22,51 | 2,49 | 3,64 | 2.948.124,66 | 0,54 |
| BRADERCO F I A SELECTION | Artigo 8º II, Alínea a | 22,98 | 2,32 | -1,29 | 10.669.442,84 | 1,95 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE | Artigo 8º IV, Alínea b | 35,06 | 3,16 | -9,84 | 1.288.200,00 | 0,24 |
| FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA | Artigo 8º IV, Alínea b | 85,88 | 7,74 | -22,41 | 722.146,50 | 0,13 |
| RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII | Artigo 8º IV, Alínea b | 139,04 | 12,54 | -33,69 | 90.172,87 | 0,02 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de janeiro de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 19,85 % do patrimônio líquido do fundo BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO (Art. 8, Inciso II, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;