



**BALNEÁRIO CAMBORIÚ**  
MAIO 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 21.07.2020.

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

71,74%

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	11,97	1,48	-3,44	2.319.981,62	0,45	192.693.340,60	1,20
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	4,97	2,09	2,01	2.985.034,46	0,57	1.394.299.565,08	0,21
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,36	1,47	-3,71	3.177.532,86	0,61	387.297.132,56	0,82
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,41	1,50	-3,69	42.224.808,03	8,13	5.454.809.775,70	0,77
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,48	1,50	-3,82	63.357.087,37	12,19	5.962.762.833,75	1,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,37	0,95	0,71	13.421.745,37	2,58	1.322.670.343,87	1,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00	2,11	1,92	25.349.395,12	4,88	8.882.233.150,63	0,29
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,00	1,00	-8,51	3.568.034,04	0,69	1.970.647.318,20	0,18
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,26	0,95	0,62	4.392.418,81	0,85	572.696.185,90	0,77
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,85	1,40	3,93	45.731,03	0,01	16.970.991.295,24	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,97	2,11	1,99	23.638.907,07	4,55	4.431.593.608,10	0,53
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,17	2,45	2,30	3.188.509,69	0,61	285.523.357,55	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,34	1,25	0,64	781.525,33	0,15	676.970.933,69	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,07	0,79	59.915.038,53	11,53	10.653.642.517,78	0,56
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,03	1,38	3,85	7.739.015,57	1,49	12.026.220.422,43	0,06
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,10	1,60	-2,56	1.107.393,75	0,21	1.625.537.568,35	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,22	0,80	-0,15	3.187.215,98	0,61	991.231.960,37	0,32
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,14	1,83	1,41	1.333.181,01	0,26	883.847.989,19	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,04	3,07	5.690.140,00	1,10	191.363.086,93	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,36	0,05	3,09	2.834.798,00	0,55	216.835.484,25	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,27	1,44	-0,83	270.257.493,64	52,01		

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	0,07	0,22	1,44	3.788.731,91	0,73	8.197.239.570,61	0,05
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,26	1,59	-2,29	12.150.101,24	2,34	418.397.514,74	2,90
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,33	0,64	5.877.427,43	1,13	4.656.011.205,04	0,13
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,82	1,15	0,93	6.297.049,88	1,21	804.662.449,97	0,78
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,11	2.458.107,63	0,47	2.574.764.271,12	0,10
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,23	1,01	5,76	2.115.245,89	0,41	247.908.135,19	0,85
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	15,10	1,75	-3,50	18.490.637,77	3,56	784.739.833,59	2,36
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,92	0,54	1,82	24.939.969,50	4,80	5.202.369.354,06	0,48
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,51	1,21	5,76	7.018.989,63	1,35	956.403.313,18	0,73
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,31	0,16	5,06	11.040.371,72	2,12	796.370.773,85	1,39
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,13	2,49	2,82	6.329.692,36	1,22	82.253.612,94	7,70
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>5,77</b>	<b>0,99</b>	<b>0,68</b>	<b>100.506.324,96</b>	<b>19,34</b>		

## 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	32,57	-0,14	-1,17	1.988.658,24	0,38	112.287.842,90	1,77
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>32,57</b>	<b>-0,14</b>	<b>-1,17</b>	<b>1.988.658,24</b>	<b>0,38</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,56</b>	<b>1,31</b>	<b>-0,45</b>	<b>372.752.476,84</b>	<b>71,74</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,19%

#### 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	43,39	8,54	-24,42	5.743.528,24	1,11	289.593.275,34	1,98
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	42,94	8,49	-24,27	10.398.714,15	2,00	577.291.375,77	1,80
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>43,04</b>	<b>8,51</b>	<b>-24,34</b>	<b>16.142.242,39</b>	<b>3,11</b>		

#### 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 FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	42,59	8,35	-23,58	1.510.772,46	0,29	15.856.921,41	9,53
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	42,78	7,86	-30,73	7.486.946,24	1,44	640.262.757,81	1,17
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	45,75	4,96	-33,91	12.622.865,83	2,43	378.598.295,66	3,33
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	37,59	4,80	-27,09	8.327.634,34	1,60	851.341.431,12	0,98
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	40,26	6,42	-26,21	7.284.939,10	1,40	1.845.404.610,84	0,39
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	42,84	6,18	-22,20	17.189.777,67	3,31	1.839.190.673,30	0,93
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,14	7,94	-23,23	2.803.907,57	0,54	700.479.562,12	0,40
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	57,79	0,86	-45,05	1.677.903,24	0,32	396.958.694,35	0,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,04	10,28	-16,87	6.499.996,12	1,25	1.808.642.265,33	0,36
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,60	8,34	-23,61	2.527.586,30	0,49	926.402.790,16	0,27
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	42,96	7,16	-20,56	2.487.877,60	0,48	942.047.097,60	0,26
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	44,90	7,55	-24,83	2.299.583,16	0,44	601.617.138,96	0,38
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,32	7,50	-20,43	1.889.969,76	0,36	768.284.939,45	0,25
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	46,53	4,76	-30,42	9.001.263,70	1,73	950.738.261,40	0,95
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	50,11	12,38	-21,38	3.074.459,23	0,59	1.784.922.963,95	0,17
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	42,55	5,36	-28,85	7.550.739,57	1,45	3.016.388.876,97	0,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	50,53	9,18	-36,23	4.507.870,65	0,87	1.596.760.931,95	0,28
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>43,13</b>	<b>6,59</b>	<b>-27,37</b>	<b>98.744.092,54</b>	<b>19,00</b>		

## 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	31,30	5,18	-6,73	10.999.292,51	2,12	405.852.853,75	2,71
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>31,30</b>	<b>5,18</b>	<b>-6,73</b>	<b>10.999.292,51</b>	<b>2,12</b>		

### Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GAVEA	GAVEA	GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	66,15	-0,24	-1,18	915.174,63	0,18	20.384.112,51	4,49
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	32,07	0,00	-9,73	2.302.748,19	0,44	139.180.433,62	1,65
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>29,13</b>	<b>-0,07</b>	<b>-7,41</b>	<b>3.217.922,82</b>	<b>0,62</b>		

### 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	26,22	0,29	-23,93	1.086.952,00	0,21	129.917.710,00	0,84
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	51,31	2,72	-37,04	585.990,00	0,11	492.638.223,00	0,12
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,76	1,74	-34,92	88.504,11	0,02	15.005.396,71	0,59
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>38,39</b>	<b>1,16</b>	<b>-29,35</b>	<b>1.761.446,11</b>	<b>0,34</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>39,69</b>	<b>6,43</b>	<b>-25,20</b>	<b>130.864.996,37</b>	<b>25,19</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,07%

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	25,33	3,99	24,03	1.860.423,61	0,36	12.156.536,19	15,30
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	29,19	5,57	27,11	6.050.864,60	1,16	235.083.784,18	2,57
Sub-total Artigo 9º A, II			34,58	5,15	26,25	7.911.288,21	1,52		

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	25,65	2,78	27,29	8.063.863,51	1,55	1.133.955.741,98	0,71
Sub-total Artigo 9º A, III			25,65	2,78	27,29	8.063.863,51	1,55		
Investimentos no Exterior			23,26	3,90	29,60	15.975.151,72	3,07		
Total						519.592.624,93	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	270.257.493,64	52,01	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	100.506.324,96	19,34	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.988.658,24	0,38	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	372.752.476,84	71,74				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	16.142.242,39	3,11	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	98.744.092,54	19,00	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	10.999.292,51	2,12	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.217.922,82	0,62	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.761.446,11	0,34	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	130.864.996,37	25,19				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	7.911.288,21	1,52	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.063.863,51	1,55	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.975.151,72	3,07				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

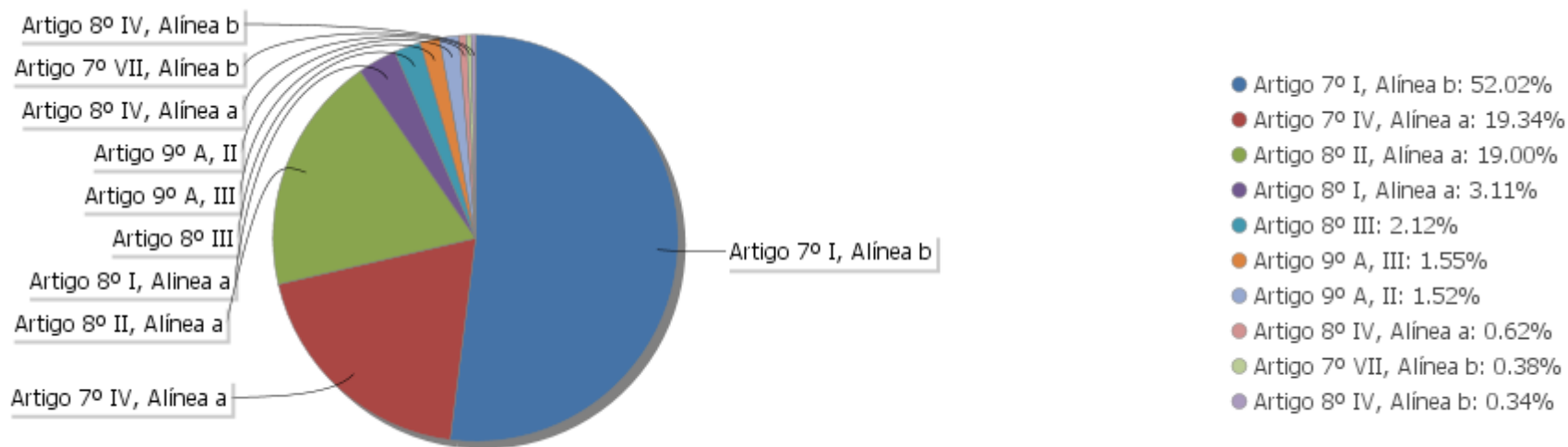
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,44 609,21	-0,83 -54,25	-1,77 -205,85	0,57 29,52	7,66 157,24	3.840.695,92	-2.180.365,63
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,99 420,26	0,68 43,90	-0,22 -25,35	1,62 84,46	8,71 178,87	1.011.042,69	910.793,82
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,14 -57,45	-1,17 -76,10	-0,33 -37,73	-1,26 -65,77	32,56 668,52	-2.697,72	-24.331,70
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,51 -0,06	-24,34 0,08	-16,06 0,03	-19,16 0,08	-9,02 0,90	1.262.722,25	-4.331.440,75
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	6,59 -1,98	-27,37 -2,95	-20,48 -4,38	-20,66 -1,41	-9,19 0,73	6.150.383,04	-35.298.906,73
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,18 -3,38	-6,73 17,69	0,40 16,50	-4,28 14,97	10,97 20,89	520.071,23	-551.500,50
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,07 -8,64	-7,41 17,01	-10,28 5,82	-3,38 15,87	-11,05 -1,12	-2.232,92	-253.441,92
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,16 -7,41	-29,35 -4,93	-13,23 2,86	-20,39 -1,15	-5,14 4,78	20.145,55	-732.217,54
Artigo 9º A, II % do CDI	5,15 2.183,86	26,25 3.167,01				301.339,72	1.411.288,21
Artigo 9º A, III % do CDI	2,78 1.179,59	27,29 1.773,53	26,70 3.099,57	25,05 1.305,26	53,85 1.105,57	181.523,50	1.419.993,51
						13.282.993,26	-39.630.129,23

## Análise de Liquidez

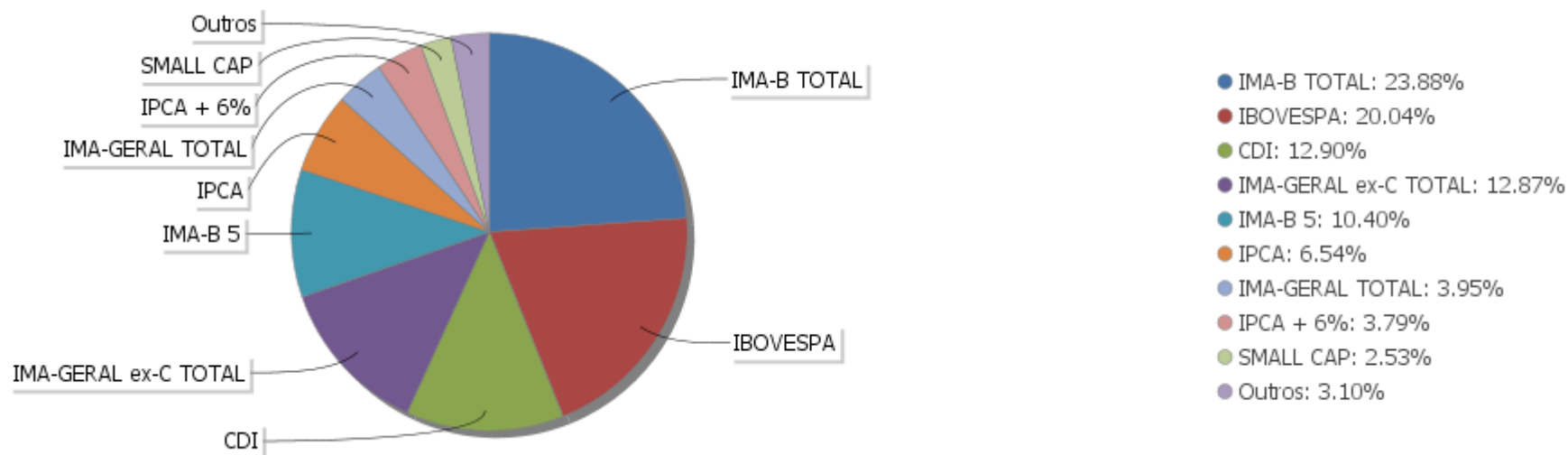
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	479.249.302,51	92,24	479.249.302,51	92,24
de 31 a 364 dias	24.143.385,33	4,65	503.392.687,84	96,88
acima de 365 dias	16.199.937,09	3,12	519.592.624,93	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

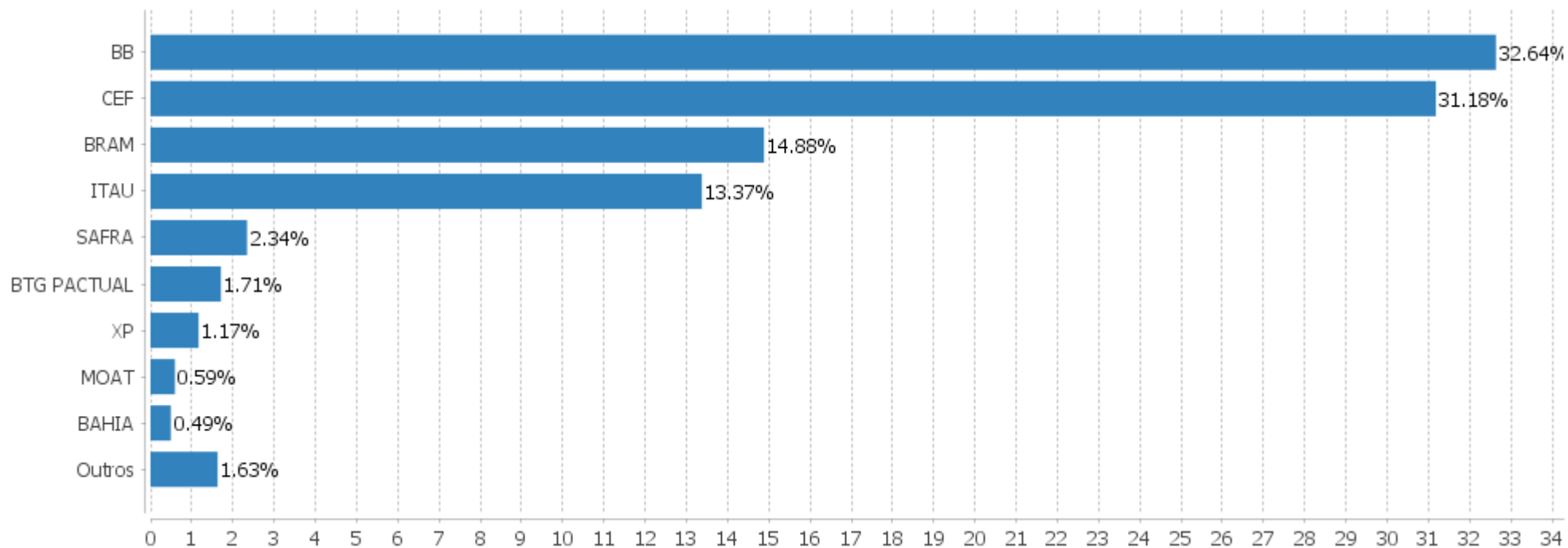


### Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,22	-2,06	-10,98	3,35	2,61								-7,33
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07								2,17
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54								-9,50
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

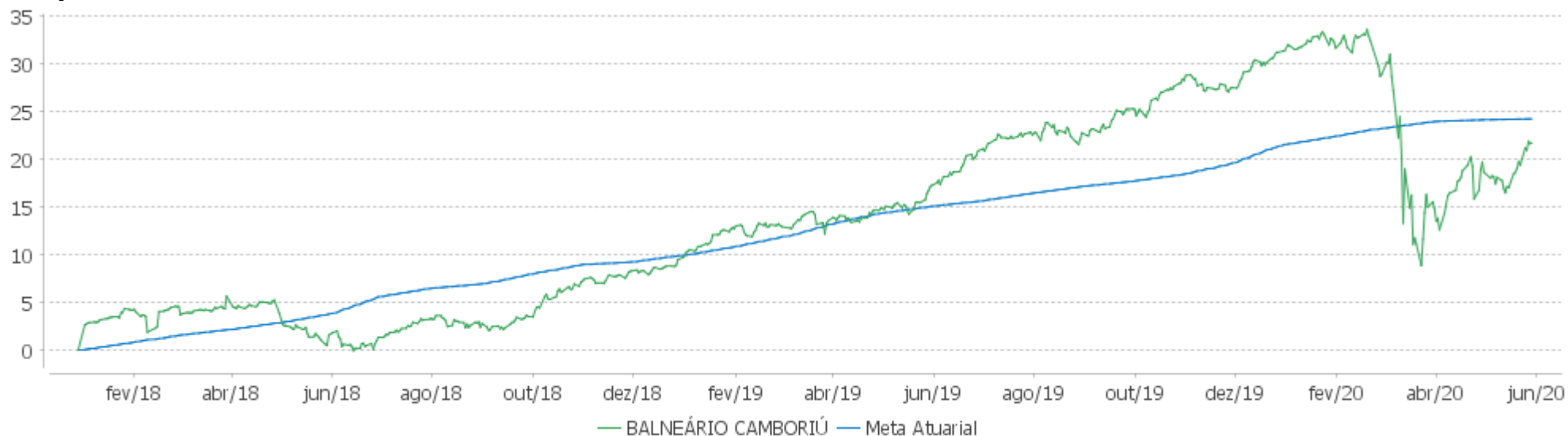
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

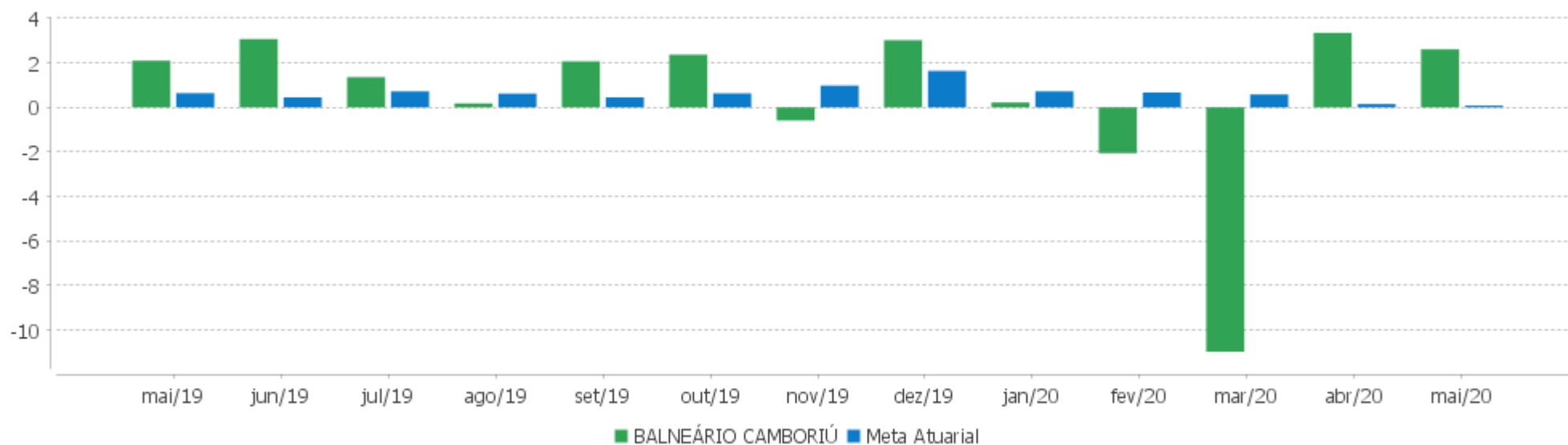
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	16	55,17	03 meses	-5,60	0,79	-6,38	27,26
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	44,83	06 meses	-4,53	3,85	-8,38	19,87
			12 meses	3,79	7,91	-4,12	14,29
			24 meses	19,87	19,69	0,19	10,56
			36 meses				
Desde 29/12/2017				21,74	24,20	-2,46	10,09
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2018-01					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,98	2020-03					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,45 0,93	2,30 5,94	0,88 5,20	3,62 5,32	10,48 3,80	28,40 -3,59	41,01 -2,50
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,82 -0,19	-4,48 -0,16	-1,91 -0,20	6,23 -0,45	31,21 -0,78	42,33 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,02	1,92 -0,11	0,74 -0,08	3,15 -0,14	9,15 -0,31	23,37 -0,56	35,19 -0,90
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	2,09 -0,03	2,01 -0,02	0,83 0,01	3,26 -0,03	9,31 -0,14	23,29 -0,64	34,89 -1,21
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,01	1,99 -0,04	0,77 -0,05	3,20 -0,09	9,26 -0,20	23,45 -0,48	35,33 -0,77
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,48 -0,04	-3,44 0,20	-4,07 0,25	-1,54 0,16	6,64 -0,04	31,52 -0,48	42,53 -0,98
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,95 -0,06	0,71 -0,16	-0,21 -0,08	1,62 -0,15	7,18 -0,41	21,48 -0,91	32,13 -1,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,40 -0,02	3,93 -0,11	2,42 -0,05	4,57 -0,12	11,04 -0,27	25,67 -0,48	38,26 -0,96
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,83 1,62	1,41 -1,04	0,43 -0,71	2,52 -1,68	8,26 0,11	29,72 9,62	41,51 12,06
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 -0,72	-0,15 3,49	-0,36 3,95	0,63 2,33	4,61 -2,07	14,40 -17,60	23,87 -19,63
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,04 -0,04	3,07 0,84	1,19 0,38	4,45 0,55	8,27 0,30	20,55 0,81	27,50 -2,96
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 -0,05	-3,71 -0,07	-4,35 -0,04	-1,79 -0,09	6,45 -0,23	31,02 -0,97	41,88 -1,63
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,60 0,08	-2,56 1,07	-3,53 0,79	-0,38 1,32	7,86 1,18		
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 -0,27	0,64 4,28	0,03 4,35	1,57 3,27	6,31 -0,37	18,52 -13,48	30,05 -13,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,07 0,10	0,79 -0,00	-0,15 0,00	1,76 0,05	7,59 0,17	22,37 0,40	33,47 0,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,38 1,76	3,85 4,01	2,37 2,99	4,46 3,48	11,99 10,11	27,82 21,20	38,17 28,50
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,05	3,09	1,21	4,49	8,34	20,72	27,71

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 6% p.p.	-0,17	0,65	0,07	0,29	0,19	0,63	-1,74
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,50	-3,69	-4,36	-1,79	6,48	31,36	42,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,06	-0,04	-0,09	-0,20	-0,64	-1,05
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,95	0,62	-0,29	1,51	7,11	21,34	32,06
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,02	-0,18	-0,14	-0,20	-0,31	-0,63	-0,99
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,00	-7,95	-8,27	-5,45	4,09	37,43	46,99
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,03	-0,07	-0,06	0,04	-0,07	-0,65	-1,05
BRADESCO H FI RF NILO	1,75	-3,50	-4,38	-1,52	7,49	33,68	48,30
% do CDI	744,21	-227,36	-508,59	-79,31	153,79	291,59	240,30
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1,59	-2,29	-3,16	-0,29	9,09	35,32	46,44
% do CDI	674,09	-148,63	-367,28	-15,03	186,64	305,75	231,03
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,22	1,44	0,81	1,81	4,67	11,15	19,58
% do CDI	94,62	93,88	93,86	94,36	95,91	96,53	97,42
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,26	1,11	0,48	1,47	4,27	10,77	19,35
% do CDI	108,46	72,02	55,88	76,39	87,61	93,25	96,29
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	1,21	5,76	3,66	6,33	12,81	26,83	42,56
% do CDI	513,69	374,40	424,87	329,74	262,98	232,25	211,76
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,33	1,12	0,47	1,48	4,25	10,73	19,09
% do CDI	139,24	73,00	55,08	77,07	87,22	92,88	94,97
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	2,49	2,82	1,37	4,31	11,42	36,47	
Var. IPCA + 6% p.p.	2,41	0,60	0,56	0,41	3,46	16,72	
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	0,16	5,06	4,28	5,54	12,08		
% do CDI	66,97	328,59	496,57	288,68	248,11		
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	1,01	-8,43	-8,67	-6,05	3,37	36,58	45,84
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,55	-0,46	-0,57	-0,80	-1,49	-2,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	1,15	0,93	-0,11	1,86	7,70	22,61	33,94
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,13	0,05	0,02	0,09	0,11	0,22	0,26
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,54	1,82	1,22	2,17	7,84	19,42	32,39
Var. IPCA p.p.	0,92	1,99	1,84	1,19	5,96	12,80	22,72
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	-0,14	-1,17	-0,33	-1,26	32,56	30,21	-24,89
% do CDI	-57,45	-76,10	-37,73	-65,77	668,52	261,52	-123,83
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	-0,24	-1,18	0,13	18,33	14,53	146,31	184,55
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,33	-3,40	-0,69	14,43	6,56	126,57	154,08
FIP CAIXA CYRELA	0,00	-9,73	-13,84	-9,82	-20,33	-16,71	
Var. IBOVESPA p.p.	-8,57	14,69	2,26	9,43	-10,40	-30,58	
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	1,41	-34,92	-2,87	-46,56	-42,25	-50,63	

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IFIX p.p.	-0,66	-18,03	7,46	-38,51	-46,37	-70,66	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE	0,29	-23,93	-13,32	-19,65	-2,04	10,87	
Var. IFIX p.p.	-1,79	-7,04	-2,99	-11,60	-6,15	-9,17	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	2,72	-37,04	-14,57	-15,84	-1,73	3,03	
Var. IFIX p.p.	0,64	-20,15	-4,24	-7,79	-5,85	-17,00	
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	4,96	-33,91	-27,77	-25,68	-8,46	14,09	31,29
Var. SMALL CAP p.p.	-0,11	-3,19	-2,95	-3,72	-6,77	-11,36	-17,69
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	7,16	-20,56	-13,25	-13,38	0,13	32,07	86,32
Var. IBOVESPA p.p.	-1,40	3,86	2,85	5,87	10,06	18,20	46,94
BRADESCO F I A SELECTION	7,86	-30,73	-21,10	-25,75	-17,66	4,91	43,56
Var. IBOVESPA p.p.	-0,71	-6,31	-5,01	-6,50	-7,74	-8,97	4,18
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	9,18	-36,23	-30,73	-29,72	-18,72	6,36	36,83
Var. IBOVESPA p.p.	0,62	-11,80	-14,63	-10,47	-8,80	-7,52	-2,54
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	8,34	-23,61	-17,12	-17,24	-7,03	16,64	50,16
Var. IBOVESPA p.p.	-0,23	0,81	-1,02	2,01	2,89	2,77	10,79
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	0,86	-41,01	-36,30	-31,00	-8,37	23,23	21,47
% do CDI	366,32	-2.665,29	-4.213,06	-1.615,05	-171,78	201,08	106,82
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5,36	-28,85	-20,97	-23,06	-6,21	20,72	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	7,50	-20,43	-16,30	-13,65	-1,18	31,96	50,60
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,50	4,65	2,56	3,95	4,33	2,42	5,01
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	8,35	-22,78	-15,81	-17,03	-6,22	20,41	54,62
Var. IBRX 100 p.p.	-0,17	1,41	0,54	1,64	2,71	3,64	12,97
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	6,42	-26,21	-17,19	-20,88	-15,67	7,33	31,00
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,42	-1,13	1,67	-3,28	-10,17	-22,21	-14,58
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,28	-16,87	-12,27	-10,89	3,46	41,18	67,32
Var. IBOVESPA p.p.	1,71	7,55	3,83	8,35	13,39	27,31	27,94
FIA CAIXA CONSUMO	7,55	-19,23	-13,14	-12,58	8,37	29,19	32,07
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,10	-0,17	0,10	-0,02	0,68	-3,41	-4,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4,76	-30,42	-24,26	-21,69	-2,38	20,38	42,95
Var. IBOVESPA p.p.	-3,80	-6,00	-8,16	-2,45	7,55	6,50	3,58
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	7,94	-23,23	-17,31	-16,88	-5,23	19,25	44,26
Var. IBOVESPA p.p.	-0,63	1,19	-1,22	2,37	4,69	5,37	4,88
BB AÇÕES DIVIDENDOS	4,80	-27,09	-19,79	-21,10	-15,56	10,45	24,38
Var. IBOVESPA p.p.	-3,77	-2,67	-3,69	-1,85	-5,64	-3,43	-14,99
MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	12,38	-21,38	-13,27	-14,45	2,24	37,41	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	6,18 -2,39	-22,20 2,22	-16,86 -0,76	-14,08 5,17	2,67 12,59	36,66 22,78	70,82 31,44
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME Var. IBOVESPA p.p.	5,18 -3,38	-6,73 17,69	0,40 16,50	-4,28 14,97	10,97 20,89	16,26 2,39	39,01 -0,36
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	8,49 -0,08	-24,27 0,15	-16,01 0,08	-19,09 0,16	-9,96 -0,04	13,28 -0,60	37,64 -1,73
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	8,54 -0,03	-24,52 -0,10	-16,18 -0,08	-19,31 -0,06	-10,16 -0,23	13,60 -0,28	38,29 -1,08
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	3,99 -4,58	40,31 64,74	25,26 41,36	37,42 56,67	65,74 75,66		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	5,57 5,49	41,04 38,82	33,59 32,77	37,84 33,94			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,78 -5,79	27,29 51,71	26,70 42,80	25,05 44,30	53,85 63,77	66,23 52,36	116,02 76,65
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	3,59	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	0,80	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,94	6,51	14,65	19,54
SELIC	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,11
<b>Meta Atuarial</b>							

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

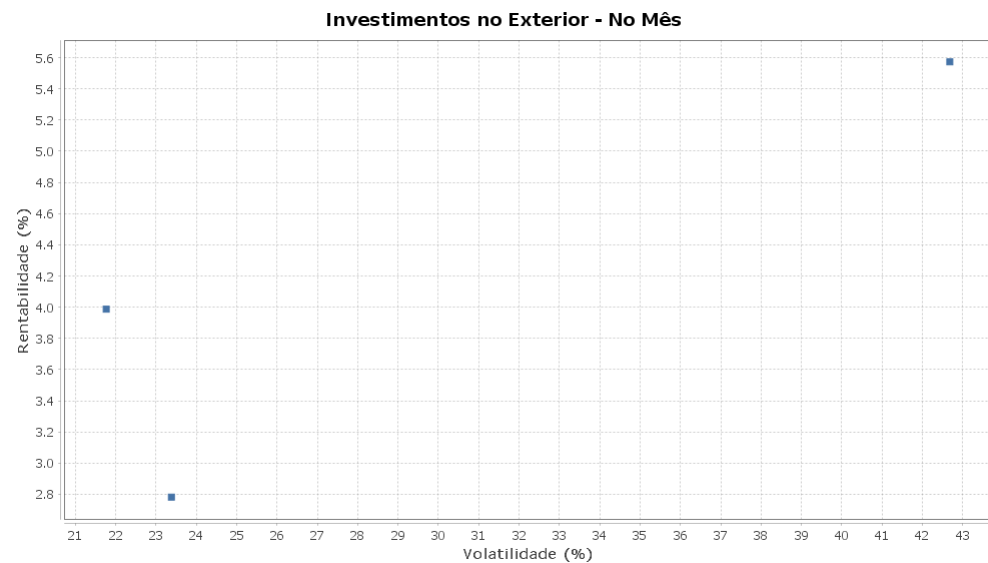
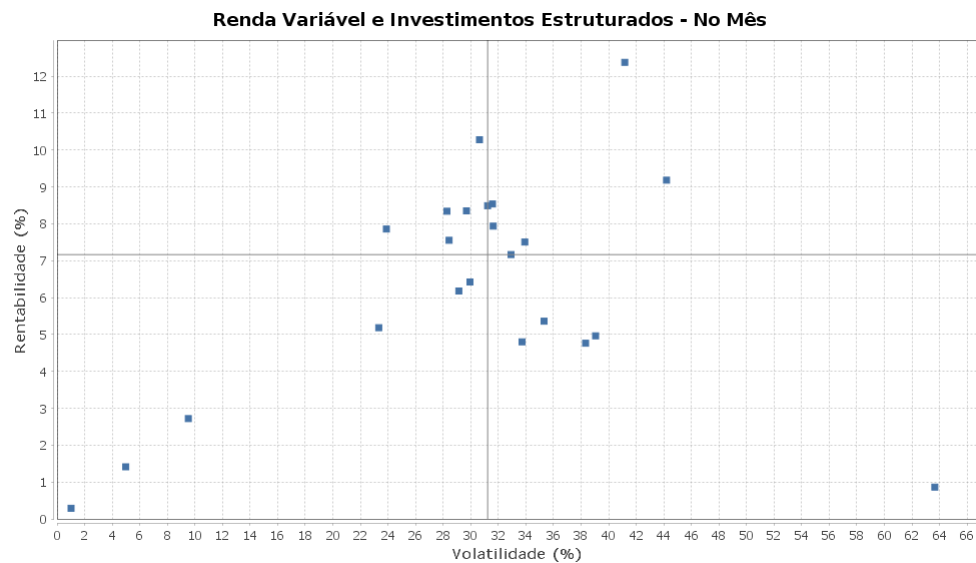
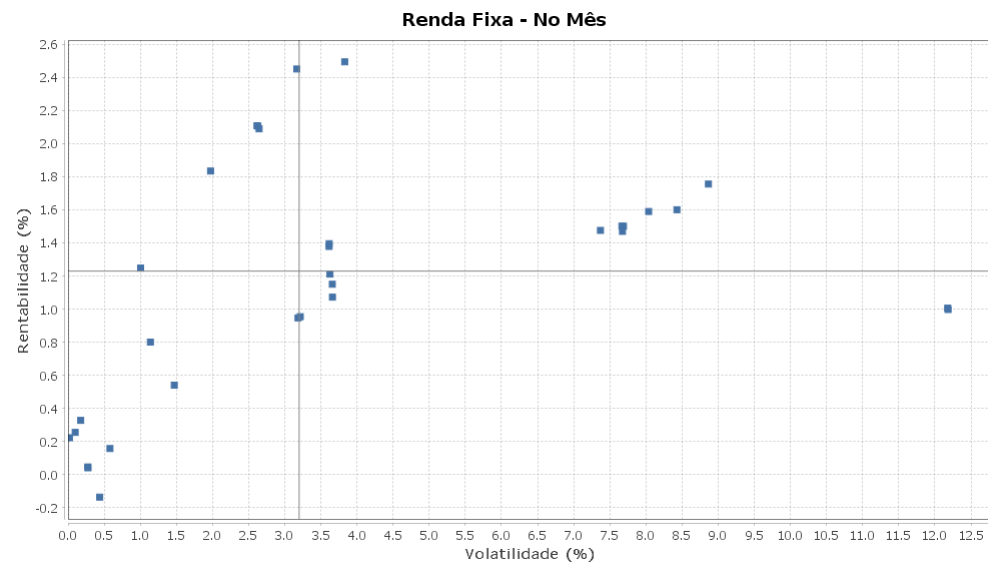
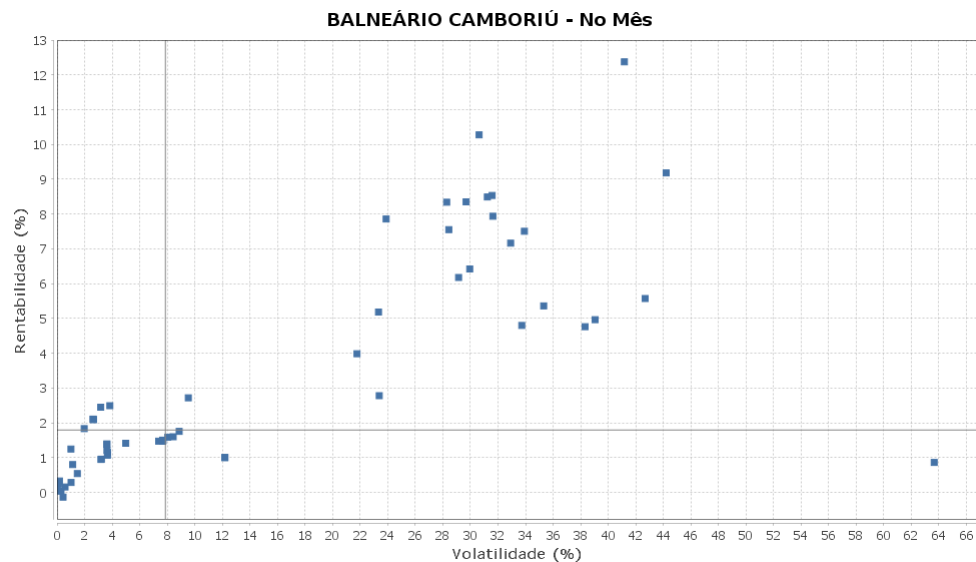
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
219	05/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	930.000,00	252.625,12821404	3,6813440000
220	05/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	123.169,91	33.457,86484501	3,6813440000
232	05/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	15.000,00	4.074,59884216	3,6813440000
239	05/05/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	175.652,00	58.637,27392025	2,9955690000
243	05/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.899,84	837,94957600	2,2672485960
221	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	122.527,45	0,00	33.257,16660306	3,6842420000
222	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	9.100,00	2.469,97889932	3,6842420000
223	11/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.489,09	404,13698357	3,6846170000
249	11/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.644,54	0,00	20.997,10413700	2,2691005240
224	12/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	271.401,50106742	3,6845780000
251	13/05/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	6.620,23607349	151,0520152000
242	15/05/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	0,00	156.697,46	70.391,16711400	2,2260954950
247	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.900.339,78	0,00	837.221,37857500	2,2698175520
248	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.800.000,00	793.015,27931800	2,2698175520
225	18/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.897.376,85	0,00	1.057.312,01497076	3,6861180000
245	18/05/2020	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	900.000,00	0,00	137.990,94431300	6,5221671210
246	18/05/2020	BB AÇÕES DIVIDENDOS	900.000,00	0,00	66.295,19602700	13,5756442990
211	19/05/2020	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	1.000.000,00	0,00	1.552,40394242	644,1622394000
212	19/05/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	1.000.000,00	0,00	83.209,55980653	12,0178499000
213	19/05/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	5.000.000,00	416.047,79903267	12,0178499000
214	19/05/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	1.000.000,00	83.209,55980653	12,0178499000
217	19/05/2020	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	4.000.000,00	0,00	2.433.474,14023077	1,6437405000
215	20/05/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	1.000.000,00	83.200,65740500	12,0191358000
226	20/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	751.080,34	0,00	203.688,54877534	3,6873960000
233	20/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	897.188,72	0,00	243.312,27782424	3,6873960000
216	21/05/2020	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	2.000.000,00	166.383,64116040	12,0204125000
227	21/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	971.737,48	0,00	263.487,08740726	3,6879890000
244	21/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	156.697,46	0,00	68.999,22092200	2,2710033230

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
250	22/05/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	1.000.000,00	0,00	5.118,45965976	195,3712770000
234	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.000.000,00	0,00	542.251,27002026	3,6883270000
235	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.711,25635010	3,6883270000
240	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.000.000,00	659.725,03979791	3,0315660000
218	25/05/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	229.334,86467867	4,3604360000
228	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	166.769,87	45.203,84573163	3,6892850000
236	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	87.487,01	23.713,81175485	3,6892850000
229	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.396.676,12	920.070,58971395	3,6917560000
230	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	17.504,56	4.741,52679646	3,6917560000
237	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	12.000,00	3.250,48567673	3,6917560000
238	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	22.380,31	6.062,23975799	3,6917560000
231	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	16.000,00	4.333,41747386	3,6922360000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,22	3.788.731,91	0,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,02	0,26	2.458.107,63	0,47
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,18	0,03	0,33	5.877.427,43	1,13
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,27	0,03	0,05	2.834.798,00	0,55
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,27	0,03	0,04	5.690.140,00	1,10
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,44	0,04	-0,14	1.988.658,24	0,38
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,58	0,07	0,16	11.040.371,72	2,12
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,17	1,25	781.525,33	0,15
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	1,02	0,12	0,29	1.086.952,00	0,21
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,14	0,16	0,80	3.187.215,98	0,61
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,47	0,18	0,54	24.939.969,50	4,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,97	0,30	1,83	1.333.181,01	0,26
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,62	0,38	2,11	23.638.907,07	4,55
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,63	0,38	2,11	25.349.395,12	4,88
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,64	0,38	2,09	2.985.034,46	0,57
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	0,45	2,45	3.188.509,69	0,61
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,18	0,38	0,95	4.392.418,81	0,85
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,21	0,38	0,95	13.421.745,37	2,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,44	1,38	7.739.015,57	1,49
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,44	1,40	45.731,03	0,01
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,62	0,44	1,21	7.018.989,63	1,35
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,66	0,44	1,15	6.297.049,88	1,21
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,66	0,43	1,07	59.915.038,53	11,53
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	3,83	0,52	2,49	6.329.692,36	1,22
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	4,98	0,59	1,41	88.504,11	0,02
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	7,37	0,84	1,48	2.319.981,62	0,45
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	0,87	1,50	42.224.808,03	8,13
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	0,87	1,47	3.177.532,86	0,61
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	0,87	1,50	63.357.087,37	12,19
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	8,04	0,91	1,59	12.150.101,24	2,34

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	8,43	0,95	1,60	1.107.393,75	0,21
BRADERCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	8,87	1,01	1,75	18.490.637,77	3,56
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	9,52	1,12	2,72	585.990,00	0,11
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	12,18	1,31	1,01	2.115.245,89	0,41
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	12,18	1,31	1,00	3.568.034,04	0,69
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	21,76	2,45	3,99	1.860.423,61	0,36
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	Artigo 8º III	23,33	2,67	5,18	10.999.292,51	2,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	23,38	2,56	2,78	8.063.863,51	1,55
BRADERCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	23,88	2,85	7,86	7.486.946,24	1,44
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,27	3,33	8,34	2.527.586,30	0,49
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	28,43	3,31	7,55	2.299.583,16	0,44
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	29,14	3,32	6,18	17.189.777,67	3,31
BRADERCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	29,69	3,48	8,35	1.510.772,46	0,29
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	29,95	3,41	6,42	7.284.939,10	1,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,63	3,66	10,28	6.499.996,12	1,25
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	31,23	3,64	8,49	10.398.714,15	2,00
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	31,58	3,68	8,54	5.743.528,24	1,11
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	31,63	3,66	7,94	2.803.907,57	0,54
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,92	3,76	7,16	2.487.877,60	0,48
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	33,72	3,73	4,80	8.327.634,34	1,60
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	33,92	3,88	7,50	1.889.969,76	0,36
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	35,31	3,92	5,36	7.550.739,57	1,45
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	38,32	4,20	4,76	9.001.263,70	1,73
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	39,05	4,29	4,96	12.622.865,83	2,43
MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	41,17	4,85	12,38	3.074.459,23	0,59
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FI NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	42,68	4,69	5,57	6.050.864,60	1,16
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	44,20	5,02	9,18	4.507.870,65	0,87
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	63,65	6,64	0,86	1.677.903,24	0,32

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O Instituto está com 15,30% do patrimônio líquido do fundo ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (Art. 9, Inciso II, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;