



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
AGOSTO 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 02.12.2020.

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

RENTA FIXA

68,86%

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	12,08	-1,81	0,65	2.418.146,31	0,43	221.907.678,25	1,09
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	4,92	0,41	4,53	3.058.777,69	0,55	1.365.086.375,25	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,49	-1,81	0,64	3.321.168,55	0,60	356.459.184,49	0,93
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	44.123.453,12	7,91	5.638.549.883,16	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	66.233.277,93	11,87	6.019.680.821,86	1,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,42	-0,72	2,54	9.657.057,43	1,73	1.263.621.088,83	0,76
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	25.978.786,41	4,66	12.740.710.327,20	0,20
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,35	-3,69	-2,83	4.288.208,56	0,77	1.987.566.192,50	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,30	-0,73	2,44	4.472.135,59	0,80	543.778.794,15	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,90	-0,77	5,06	46.225,18	0,01	16.114.955.012,29	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,37	4,46	29.251.933,75	5,24	4.251.005.212,54	0,69
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,09	0,46	5,18	3.198.701,69	0,57	286.436.026,50	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,28	0,47	2,45	275.310,58	0,05	238.494.074,76	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	2,63	39.972.957,12	7,17	10.897.747.304,90	0,37
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	12.840.819,27	2,30	13.462.808.031,45	0,10
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,31	-2,03	2,16	1.161.061,98	0,21	1.759.993.204,58	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,18	0,11	0,92	0,00	0,00	1.001.818.388,63	0,00
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,08	0,42	3,69	860.811,60	0,15	570.737.914,69	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,77	5,25	5.653.896,00	1,01	190.144.241,72	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,37	0,77	5,30	2.815.126,00	0,50	215.330.752,26	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,31	-0,96	2,28	259.627.854,76	46,55		

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	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,07	0,15	1,98	3.808.617,76	0,68	7.557.879.554,88	0,05
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,34	-1,92	2,09	12.693.883,09	2,28	590.780.511,39	2,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,14	1,28	12.182.188,42	2,18	4.687.255.346,64	0,26
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,86	-0,62	3,25	3.427.543,87	0,61	804.512.988,48	0,43
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	10.798.829,61	1,94	2.572.617.697,19	0,42
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,58	-3,73	12,29	2.245.750,30	0,40	240.076.237,79	0,94
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,22	-2,05	1,14	24.395.803,10	4,37	901.774.758,01	2,71
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,63	-0,12	2,70	25.155.396,02	4,51	5.008.664.363,26	0,50
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,53	-0,39	7,04	10.120.324,85	1,81	993.706.874,51	1,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,09	0,39	5,92	11.131.597,91	2,00	761.400.713,31	1,46
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,03	0,65	5,83	6.515.085,19	1,17	84.662.771,27	7,70
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,72	-0,68	3,05	122.475.020,12	21,96		

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	32,61	-0,14	-1,75	1.949.103,34	0,35	109.974.749,24	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			32,61	-0,14	-1,75	1.949.103,34	0,35		
Renda Fixa			7,56	-0,87	2,45	384.051.978,22	68,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,93%

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	43,94	-3,47	-14,16	6.523.176,32	1,17	373.075.822,94	1,75
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,48	-3,43	-14,10	11.794.703,09	2,11	683.983.509,09	1,72
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,62	-3,44	-14,15	18.317.879,41	3,28		

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	43,04	-2,94	-12,56	1.728.527,66	0,31	14.845.174,01	11,64
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	43,16	-1,14	-17,90	8.873.898,64	1,59	708.000.018,67	1,25
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	46,79	-1,45	-18,67	15.780.909,18	2,83	513.335.622,98	3,07
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,15	-3,41	-19,86	9.398.644,08	1,69	937.612.766,29	1,00
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	40,76	-5,18	-21,01	7.798.467,35	1,40	1.759.615.274,24	0,44
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,28	-1,58	-10,08	19.867.355,18	3,56	2.138.016.152,06	0,93
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,56	-3,01	-12,28	3.203.764,54	0,57	832.932.613,38	0,38
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	59,91	-7,99	-36,12	1.950.784,75	0,35	529.350.277,83	0,37
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,11	-0,43	-1,08	7.734.444,42	1,39	2.421.513.673,79	0,32
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,96	-3,12	-11,76	2.919.436,61	0,52	1.018.121.260,04	0,29
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	43,75	-2,88	-9,11	2.846.563,36	0,51	1.066.616.824,04	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,28	-1,59	-12,75	2.668.971,79	0,48	750.936.914,19	0,36
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,93	-3,82	-13,31	2.059.133,91	0,37	819.770.596,51	0,25
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,51	-1,38	-15,36	10.950.499,71	1,96	1.226.260.606,95	0,89
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,10	-0,20	-16,55	8.856.003,23	1,59	3.382.143.848,22	0,26
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	51,42	-3,92	-27,34	5.136.367,00	0,92	1.780.436.467,38	0,29
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	44,61	-3,67	77,72	3.757.211,96	0,67	1.132.505.119,79	0,33
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,72	-2,19	-15,38	115.530.983,37	20,71		

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	31,42	6,86	6,19	12.522.614,09	2,25	537.917.191,45	2,33
Sub-total Artigo 8º III			31,42	6,86	6,19	12.522.614,09	2,25		

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	66,02	0,01	-2,09	847.247,12	0,15	13.067.326,66	6,48
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	89,33	-0,15	-31,84	1.148.086,12	0,21	127.132.151,28	0,90
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			64,47	-0,08	-19,35	1.995.333,24	0,36		

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	26,98	2,65	-20,18	1.140.456,00	0,20	140.675.406,11	0,81
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	51,72	3,14	-34,53	609.360,66	0,11	588.319.069,28	0,10
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,70	0,15	-32,86	89.191,43	0,02	15.248.025,09	0,58
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			38,87	2,69	-26,22	1.839.008,09	0,33		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,32	-1,57	-13,67	150.205.818,20	26,93		
--	--	--	--------------	--------------	---------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,21%

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	26,75	13,92	52,26	2.283.969,91	0,41	104.699.210,62	2,18
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,16	15,26	62,98	11.344.010,55	2,03	678.997.370,55	1,67
Sub-total Artigo 9º A, II			30,61	15,04	60,44	13.627.980,46	2,44		

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	27,07	15,16	55,87	9.874.072,22	1,77	1.583.297.843,04	0,62
Sub-total Artigo 9º A, III			27,07	15,16	55,87	9.874.072,22	1,77		
Investimentos no Exterior			24,90	15,10	61,76	23.502.052,68	4,21		
Total			14,52	-0,48	-0,99	557.759.849,10	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	259.627.854,76	46,55	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	122.475.020,12	21,96	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.949.103,34	0,35	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	384.051.978,22	68,86				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	18.317.879,41	3,28	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	115.530.983,37	20,71	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	12.522.614,09	2,25	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.995.333,24	0,36	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.839.008,09	0,33	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	150.205.818,20	26,93				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	13.627.980,46	2,44	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.874.072,22	1,77	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.502.052,68	4,21				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

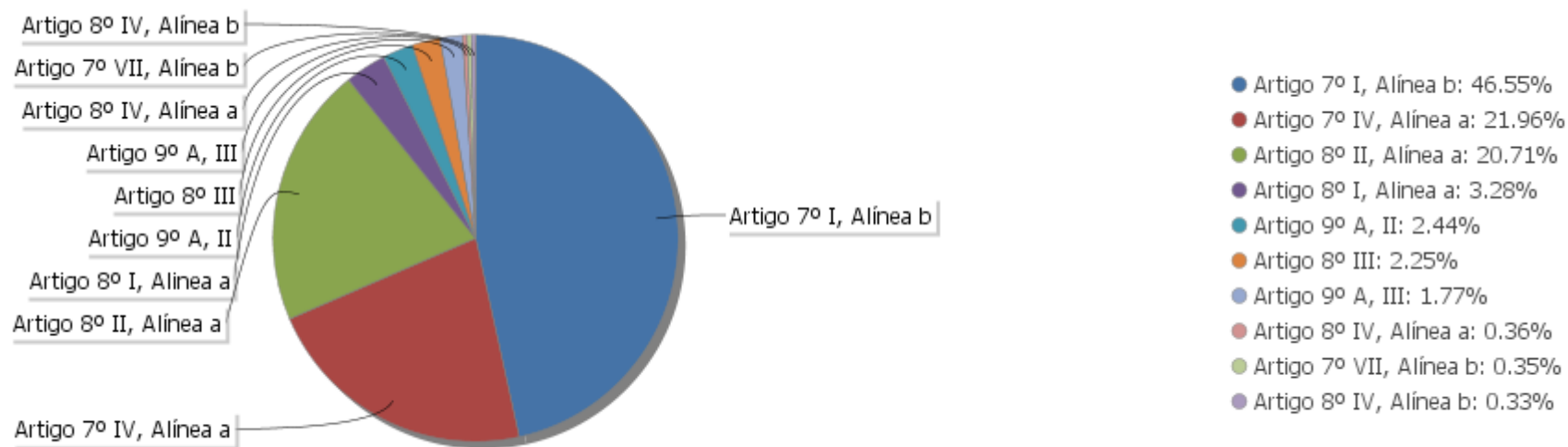
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,96 -601,30	2,28 107,87	3,14 553,64	1,31 91,59	6,95 180,06	-2.566.105,75	6.248.057,47
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,68 -422,54	3,05 144,02	2,35 414,85	2,13 148,62	7,02 181,97	-812.783,76	3.323.182,69
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,14 -86,44	-1,75 -82,50	-0,58 -102,31	-0,90 -63,04	32,44 840,41	-2.697,73	-35.312,75
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,44 -0,00	-14,15 -0,07	13,48 -0,21	-4,75 -0,14	-1,92 -0,18	-653.387,73	-2.155.803,73
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,19 1,25	-15,38 -1,31	16,50 2,81	-7,35 -2,74	-2,35 -0,61	-2.590.815,93	-19.012.015,90
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	6,86 10,30	6,19 20,26	13,85 0,16	14,30 18,91	18,01 19,75	803.792,66	971.821,08
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 3,36	-19,35 -5,28	-12,82 -26,51	-21,85 -17,24	-22,25 -20,50	-1.647,49	-194.533,35
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,69 6,13	-26,22 -12,15	4,43 -9,26	-9,39 -4,78	-2,50 -0,76	48.170,78	-654.198,97
Artigo 9º A, II % do CDI	15,04 9.405,62	60,44 4.313,24	27,08 4.770,55			1.753.351,40	4.127.980,46
Artigo 9º A, III % do CDI	15,16 9.483,09	55,87 2.641,22	22,45 3.954,81	55,15 3.845,54	68,87 1.784,17	1.300.058,39	3.230.202,22
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						-2.722.065,16	-4.150.620,78

Análise de Liquidez

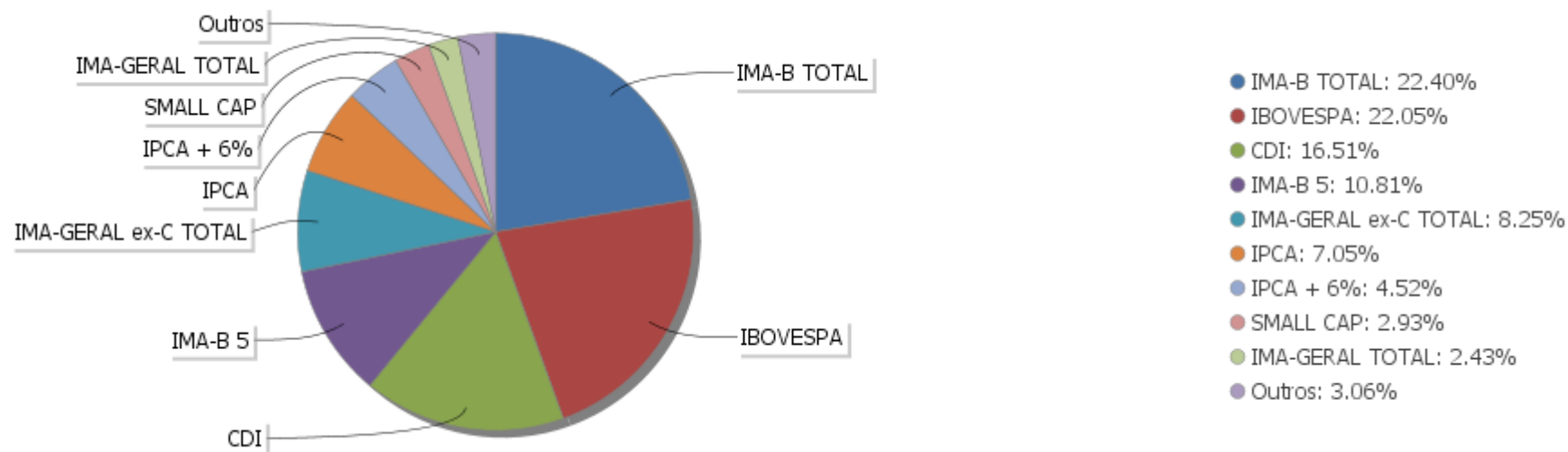
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	519.411.111,12	93,12	519.411.111,12	93,12
de 31 a 364 dias	24.415.581,53	4,38	543.826.692,65	97,50
acima de 365 dias	13.933.156,45	2,50	557.759.849,10	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

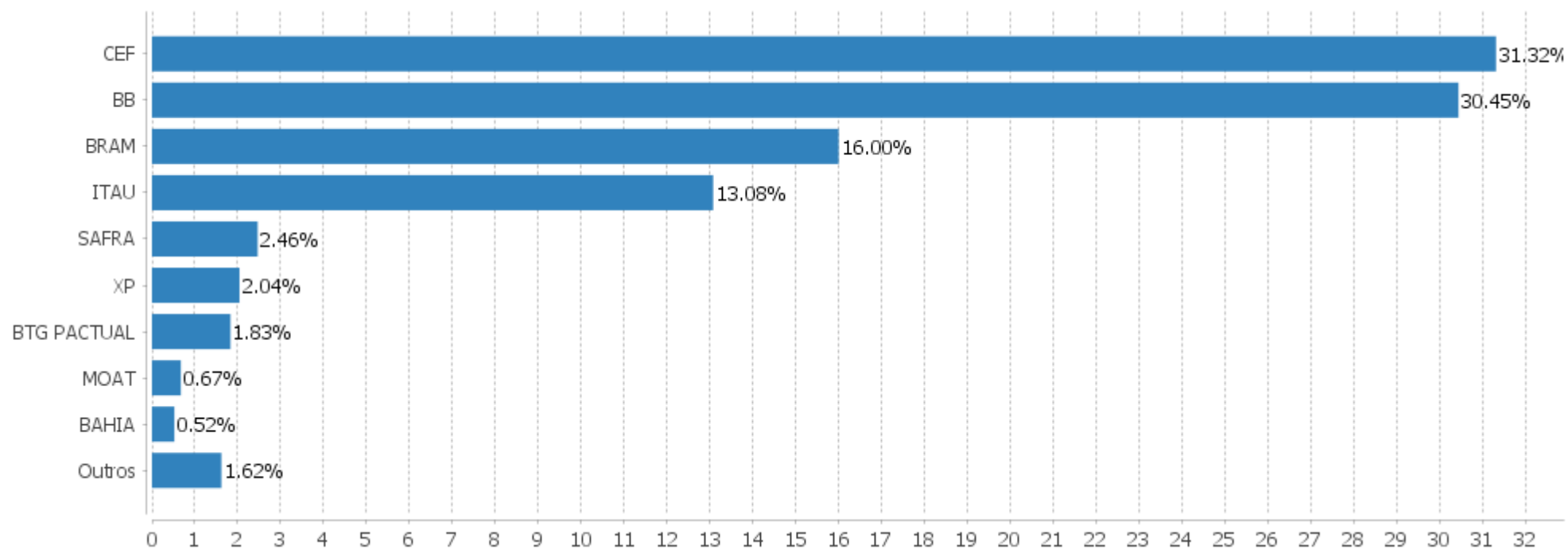


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,22	-2,06	-10,98	3,35	2,61	3,33	3,90	-0,48					-0,99
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72					4,58
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02	-1,20					-5,57
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

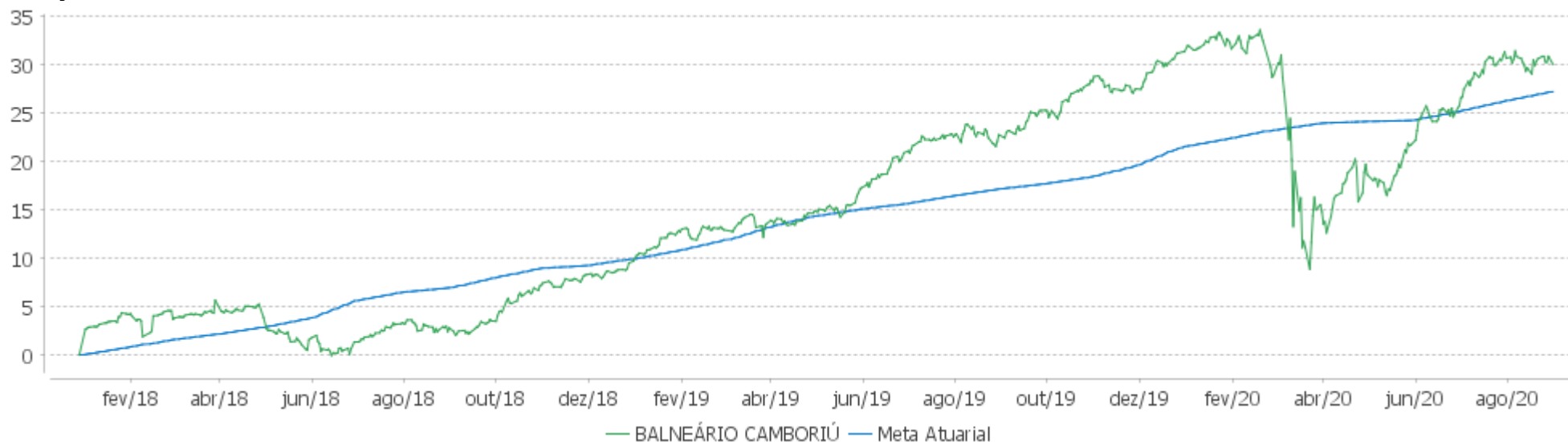
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

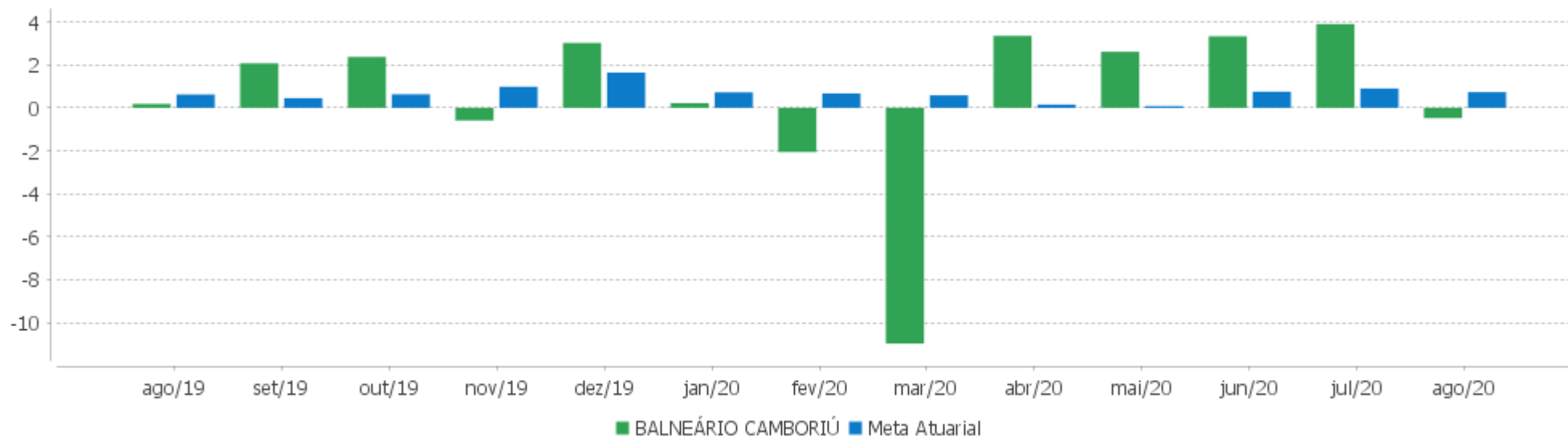
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	56,25	03 meses	6,84	2,36	4,49	7,18
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	43,75	06 meses	0,86	3,16	-2,30	19,71
			12 meses	5,95	8,50	-2,55	14,52
			24 meses	26,54	18,87	7,67	10,76
			36 meses				
Desde 29/12/2017				30,07	27,13	2,95	9,85
	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.	0,46 2,26	5,18 4,37	2,81 -1,80	3,71 3,62	9,99 3,35	30,01 -5,99	37,21 -5,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,03	4,45 -0,18	2,48 -0,07	3,24 -0,15	8,93 -0,32	24,43 -0,58	32,42 -0,91
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,02	4,53 -0,10	2,47 -0,08	3,32 -0,07	9,06 -0,18	24,40 -0,60	32,15 -1,18
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	8,95 -0,29	24,42 -0,59	32,44 -0,89
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,81 -0,02	0,65 -0,16	4,23 -0,38	-0,01 -0,10	6,38 -0,26	35,10 -0,90	40,82 -1,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 -0,02	5,06 -0,15	1,08 -0,03	3,53 -0,09	8,49 -0,22	26,36 -0,46	33,44 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,72 -0,12	2,54 -0,48	1,82 -0,31	1,60 -0,39	5,94 -0,57	22,25 -1,11	29,11 -1,80
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,42 -0,42	3,69 -1,45	2,25 -0,38	2,69 -1,11	7,87 -1,24	23,87 4,49	41,96 10,87
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11 1,91	0,92 0,12	1,07 -3,54	0,71 0,61	4,07 -2,57	14,07 -21,92	22,92 -19,29
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,77 0,04	5,25 0,59	2,12 -0,27	3,34 0,12	8,61 0,03	18,97 0,01	31,57 0,24
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,81 -0,02	0,64 -0,16	4,52 -0,09	-0,03 -0,12	6,39 -0,25	35,07 -0,92	40,60 -1,61
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,03 -0,23	2,16 1,35	4,85 0,24	1,14 1,05	8,56 1,92		
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,47 2,27	2,45 1,64	1,79 -2,82	1,82 1,73	6,06 -0,59	18,80 -17,19	27,18 -15,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,89 -0,21	2,63 -0,06	1,82 -0,06	1,67 -0,06	6,05 -0,11	23,16 0,44	30,22 0,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,56 -0,80	5,06 4,36	1,17 0,30	3,57 3,33	9,21 6,77	27,35 21,40	34,93 24,54
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,85	0,64	4,50	-0,06	6,38	35,28	41,12

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.	-0,06	-0,17	-0,11	-0,15	-0,26	-0,71	-1,08
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,77	5,30	2,14	3,38	8,69	19,14	31,85
Var. INPC + 6% p.p.	-0,07	0,16	-0,49	-0,43	-0,43	-0,24	0,76
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,73	2,44	1,81	1,52	5,84	22,09	28,99
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,04	-0,24	-0,06	-0,20	-0,32	-0,63	-0,99
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-3,69	-2,23	6,21	-2,57	4,54	43,91	47,28
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,07	-0,22	-0,16	-0,22	-0,18	-0,81	-1,23
BRABESCO H FI RF NILO	-2,05	1,14	4,81	0,22	7,23	38,46	45,98
% do CDI	-1.282,22	54,11	847,64	15,26	187,30	370,58	256,59
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-1,92	2,09	4,48	1,17	8,22	39,31	45,07
% do CDI	-1.198,28	98,63	788,47	81,56	212,87	378,77	251,50
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,79	0,68	1,16	3,42	9,79	17,31
% do CDI	113,33	84,85	119,59	81,13	88,51	94,28	96,60
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,15	1,98	0,52	1,34	3,66	9,99	17,31
% do CDI	91,21	93,47	92,47	93,29	94,89	96,20	96,62
BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	-0,39	7,04	1,21	4,91	10,58	27,98	37,65
% do CDI	-244,68	332,69	212,50	342,44	273,97	269,54	210,08
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14	1,77	0,64	1,12	3,36	9,69	17,02
% do CDI	90,67	83,59	112,31	77,76	87,05	93,36	94,95
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	0,65	5,83	2,93	4,34	10,92	31,49	
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,07	1,17	0,54	1,12	2,34	12,53	
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	-3,73	-2,78	6,17	-3,03	3,83	42,79	46,18
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,11	-0,77	-0,21	-0,68	-0,88	-1,93	-2,32
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	0,39	5,92	0,83	5,14	9,20	21,62	
% do CDI	241,94	280,09	145,57	358,41	238,32	208,25	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	-0,12	2,70	0,86	2,09	4,74	18,63	27,48
Var. IPCA p.p.	-0,36	2,00	0,00	1,85	2,30	12,68	17,09
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	-0,62	3,25	2,31	2,19	6,78	23,88	31,18
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,02	0,23	0,18	0,20	0,27	0,52	0,26
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	-0,14	-1,75	-0,58	-0,90	32,44	30,07	-24,01
% do CDI	-86,44	-82,50	-102,31	-63,04	840,41	289,74	-133,99
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	0,15	-32,86	1,29	-0,67	-39,98	-48,46	
Var. IFIX p.p.	-1,64	-19,87	-3,39	5,46	-44,70	-78,50	
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	2,65	-20,18	4,92	-9,05	0,04	17,18	
Var. IFIX p.p.	0,86	-7,19	0,24	-2,92	-4,68	-12,86	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	3,14	-34,53	3,99	-11,17	2,18	18,60	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IFIX p.p.	1,35	-21,53	-0,69	-5,03	-2,54	-11,44	
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	-1,45	-18,67	23,07	-11,11	-0,92	44,22	38,39
Var. SMALL CAP p.p.	-0,22	-4,40	-0,69	-4,15	-6,94	-15,95	-18,04
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-2,88	-9,11	14,42	-0,74	4,56	52,97	87,54
Var. IBOVESPA p.p.	0,56	4,96	0,73	3,87	6,31	23,38	47,26
BRADESCO F I A SELECTION	-1,14	-17,90	18,52	-6,49	-9,95	23,51	43,37
Var. IBOVESPA p.p.	2,30	-3,83	4,83	-1,88	-8,21	-6,08	3,09
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-3,92	-27,34	13,94	-21,07	-17,17	22,23	36,16
Var. IBOVESPA p.p.	-0,48	-13,26	0,25	-16,46	-15,43	-7,36	-4,12
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-3,12	-11,76	15,50	-4,27	2,31	33,10	52,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	2,31	1,81	0,34	4,06	3,51	12,22
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-7,99	-31,42	16,26	-25,94	-13,77	50,05	23,49
% do CDI	-4.997,33	-1.485,47	2.865,15	-1.808,65	-356,74	482,20	131,06
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,20	-16,55	17,29	-7,31	-2,64	42,50	58,37
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,82	-13,31	8,95	-8,81	-1,14	48,70	47,11
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,01	3,94	-1,51	1,57	2,51	3,92	1,91
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	-2,94	-11,65	14,41	-3,67	0,80	37,85	54,37
Var. IBRX 100 p.p.	0,43	1,81	0,26	0,83	1,93	4,50	11,22
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	-5,18	-21,01	7,05	-11,36	-11,69	15,04	25,45
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,35	-3,76	-3,41	-0,97	-8,05	-29,75	-19,75
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-0,43	-1,08	18,99	4,39	10,14	69,23	75,54
Var. IBOVESPA p.p.	3,01	12,99	5,30	9,00	11,89	39,64	35,26
FIA CAIXA CONSUMO	-1,59	-6,25	16,06	0,81	5,57	57,09	37,37
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,11	-0,72	-0,65	-0,45	-0,18	-3,04	-5,40
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-3,67	77,72	22,21				
Var. IBOVESPA p.p.	-0,23	32,30	8,52				
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-1,38	-15,36	21,66	-7,86	3,92	51,07	48,05
Var. IBOVESPA p.p.	2,06	-1,28	7,96	-3,25	5,67	21,47	7,76
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-3,01	-12,28	14,26	-5,52	0,98	39,22	46,01
Var. IBOVESPA p.p.	0,43	1,79	0,57	-0,91	2,72	9,62	5,73
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-3,41	-19,86	9,92	-11,83	-10,80	22,37	23,27
Var. IBOVESPA p.p.	0,03	-5,78	-3,77	-7,22	-9,05	-7,23	-17,01
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-1,58	-10,08	15,58	-3,91	6,20	58,35	72,99
Var. IBOVESPA p.p.	1,86	4,00	1,89	0,70	7,94	28,76	32,70
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,43	-14,10	13,42	-4,74	-1,87	28,69	38,62
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	-0,03	-0,27	-0,13	-0,13	-0,90	-1,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	-3,47 -0,03	-14,28 -0,20	13,57 -0,12	-4,80 -0,19	-2,03 -0,29	29,07 -0,52	39,34 -0,94
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	6,86 10,30	6,19 20,26	13,85 0,16	14,30 18,91	18,01 19,75	22,83 -6,76	50,69 10,41
GÂVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6% p.p.	0,01 -0,72	-2,09 -6,76	-0,92 -3,31	-0,79 -4,02	13,89 5,30	133,28 114,32	171,52 140,19
FIP CAIXA CYRELA Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 3,29	-31,84 -17,76	-24,39 -38,08	-34,94 -30,33	-39,58 -37,83	-36,89 -66,48	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	13,92 17,36	72,26 86,33	22,77 9,07	53,78 58,39	86,11 87,85		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	15,26 14,53	80,84 76,18	28,22 25,83	71,29 68,06			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	15,16 18,61	55,87 69,94	22,45 8,76	55,15 59,76	68,87 70,62	72,76 43,17	164,16 123,88
BALNEÁRIO CAMBORIÚ Var. IPCA + 6% p.p.	-0,48 -1,21	-0,99 -5,65	6,84 4,45	0,86 -2,36	5,95 -2,64	26,54 7,58	
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

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	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

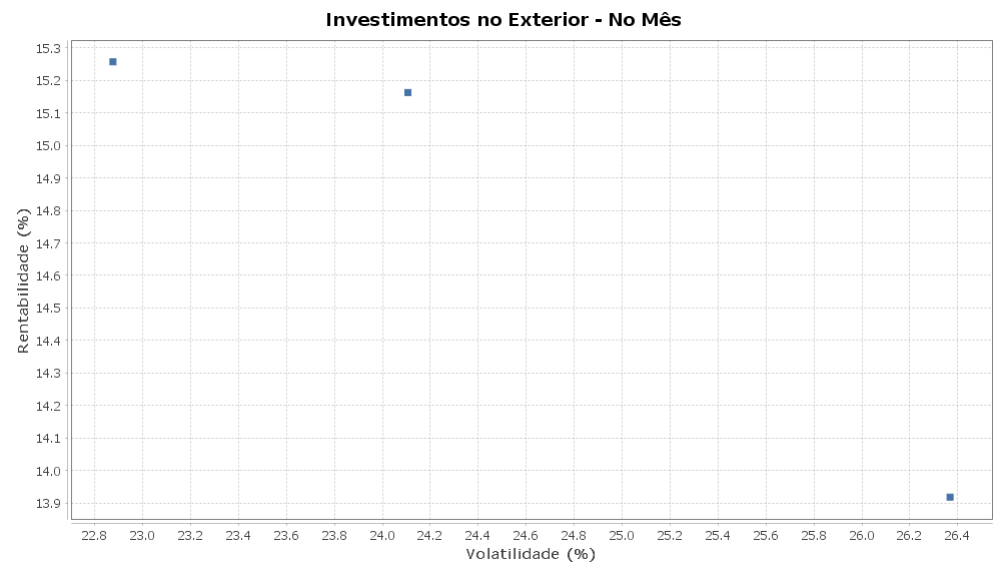
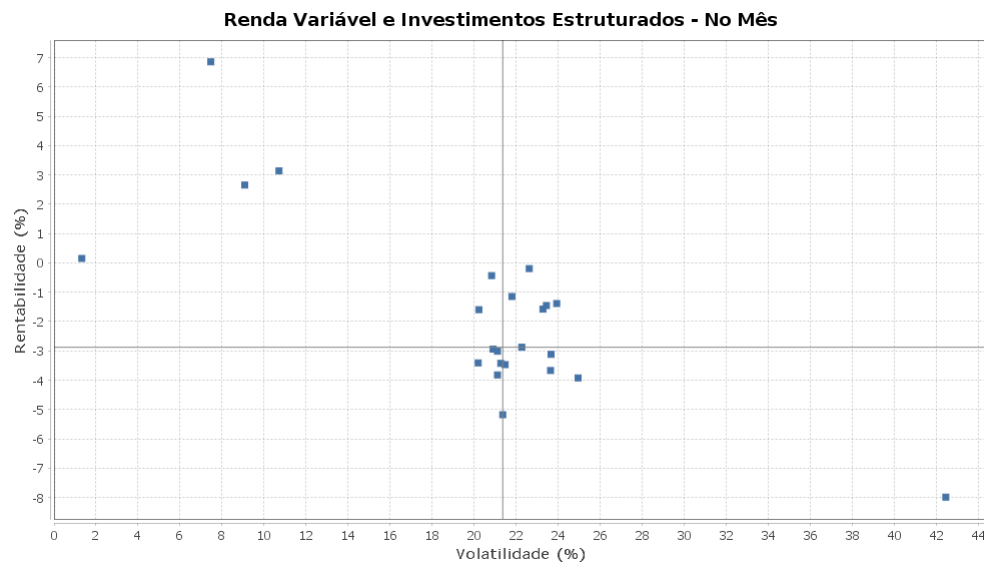
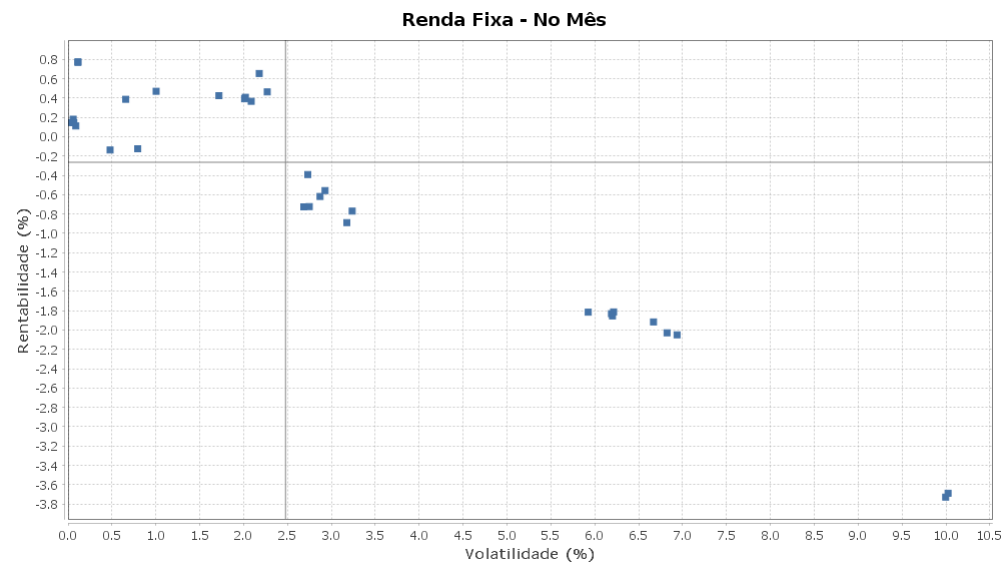
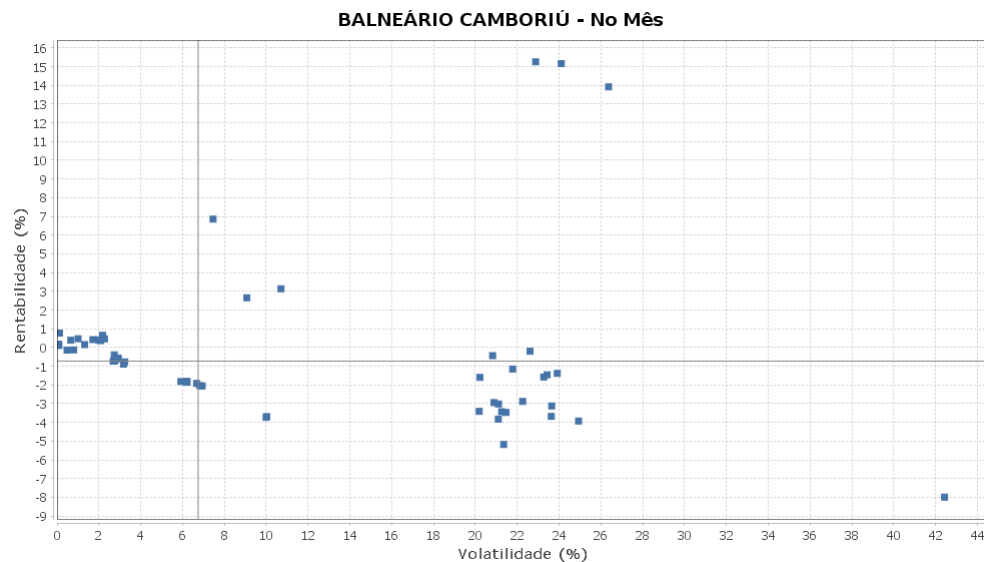
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
337	03/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	297.693,77	80.225,12253500	3,7107300000
338	03/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	12.593,82	3.393,89282700	3,7107300000
343	03/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	420.000,00	113.185,27606200	3,7107300000
344	03/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	269.488,75263800	3,7107300000
345	03/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	526.000,00	141.751,08389700	3,7107300000
329	03/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.573,85	0,00	12.509,09731900	2,2842455590
346	04/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.000,00	808,43074000	3,7108930000
360	04/08/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	6.020,90213374	166,0880675000
347	05/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	126.432,07	34.068,55891300	3,7111070000
330	05/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.573,85	0,00	12.507,62825300	2,2845138520
331	05/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	28.573,85	12.507,62825300	2,2845138520
348	06/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.785,08	1.289,17813000	3,7117290000
361	06/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	86.193,49	23.221,92433769	3,7117290000
339	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	90.000,00	0,00	24.246,44735600	3,7118840000
349	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	141.438,76	0,00	38.104,30498300	3,7118840000
326	07/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.644,54	0,00	20.848,89353000	2,2852311050
350	10/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	52.303,09	0,00	14.089,86594400	3,7121070000
351	12/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.016,81	0,00	4.314,38638700	3,7124190000
352	14/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.717,94	0,00	2.078,76249300	3,7127570000
359	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.221.434,71	2.534.720,60069729	1,2709230000
321	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	21.093,88	11.843,40256600	1,7810658620
322	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	498.250,78	279.748,65535900	1,7810658620
323	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	79.127,45	34.498,01046000	2,2936815470
327	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	466.792,66	208.723,39261100	2,2364175580
328	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	34.660,85	15.498,38037900	2,2364175580
334	17/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.190,94	0,00	26.766,68692400	2,2860856920
353	18/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.221.254,75	0,00	867.446,26082400	3,7134920000
332	18/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	501.453,51	0,00	219.319,95104000	2,2864017050

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
335	18/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	598.472,11	0,00	261.752,82702500	2,2864017050
354	19/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.929.198,00	0,00	1.327.323,94881900	3,7136360000
355	20/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	56.888,36	0,00	15.317,51025700	3,7139430000
356	20/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	871.325,46	0,00	234.609,27106300	3,7139430000
357	21/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	54.197,78	0,00	14.592,15674400	3,7141720000
340	24/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	67.457,48	18.160,28812500	3,7145600000
358	24/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	210.538,02	56.679,12756100	3,7145600000
362	27/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.490.725,21	939.603,37895600	3,7151050000
333	27/08/2020	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	500.000,00	0,00	150.013,39919600	3,3330356000
336	27/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	437.123,95081700	2,2876806410
341	28/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	25.647,96	6.902,88525800	3,7155420000
342	28/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.622,67	975,00444600	3,7155420000
324	28/08/2020	BB AÇÕES DIVIDENDOS	250.000,00	0,00	15.173,10857300	16,4765182290
325	28/08/2020	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	250.000,00	0,00	27.685,22332000	9,0300878960
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-2,07	0,15	3.808.617,76	0,68
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,07	0,00	0,37	0,18	10.798.829,61	1,94
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	-0,23	0,14	12.182.188,42	2,18
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,09	NaN	0,00	-0,56	0,11	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,11	-0,00	5,43	0,77	2.815.126,00	0,50
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,11	-0,00	5,38	0,77	5.653.896,00	1,01
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,48	0,03	0,00	-0,62	-0,14	1.949.103,34	0,35
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,66	0,29	-0,00	0,35	0,39	11.131.597,91	2,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,79	0,55	0,02	-0,36	-0,12	25.155.396,02	4,51
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,52	0,00	0,31	0,47	275.310,58	0,05
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,32	0,87	0,00	-0,00	0,15	89.191,43	0,02
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,99	0,00	0,15	0,42	860.811,60	0,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,03	0,12	0,39	25.978.786,41	4,66
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,02	1,09	0,00	0,12	0,41	3.058.777,69	0,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,09	1,10	0,04	0,10	0,37	29.251.933,75	5,24
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	2,18	1,51	0,01	0,23	0,65	6.515.085,19	1,17
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	1,42	0,01	0,13	0,46	3.198.701,69	0,57
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,68	1,21	0,01	-0,33	-0,73	4.472.135,59	0,80
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,73	1,50	0,02	-0,20	-0,39	10.120.324,85	1,81
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,75	1,25	0,02	-0,32	-0,72	9.657.057,43	1,73
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,87	1,36	0,01	-0,27	-0,62	3.427.543,87	0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,02	-0,24	-0,56	12.840.819,27	2,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,08	-0,33	-0,89	39.972.957,12	7,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,46	0,00	-0,29	-0,77	46.225,18	0,01
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,92	2,99	0,01	-0,33	-1,81	2.418.146,31	0,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	3,13	0,30	-0,32	-1,83	66.233.277,93	11,87
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,20	3,11	0,20	-0,32	-1,85	44.123.453,12	7,91
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,21	3,10	0,01	-0,32	-1,81	3.321.168,55	0,60
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,67	3,17	0,06	-0,31	-1,92	12.693.883,09	2,28
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,82	3,60	0,01	-0,32	-2,03	1.161.061,98	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,94	3,62	0,13	-0,32	-2,05	24.395.803,10	4,37
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	7,46	11,34	0,11	0,90	6,86	12.522.614,09	2,25
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	9,07	0,25	-0,00	0,27	2,65	1.140.456,00	0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	10,00	5,37	0,02	-0,39	-3,73	2.245.750,30	0,40
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,02	5,38	0,03	-0,38	-3,69	4.288.208,56	0,77
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	10,71	0,75	-0,00	0,28	3,14	609.360,66	0,11
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	11,87	0,19	-0,18	-3,41	9.398.644,08	1,69
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	20,21	12,76	0,05	-0,09	-1,59	2.668.971,79	0,48
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,82	12,70	0,16	-0,03	-0,43	7.734.444,42	1,39
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	20,89	11,95	0,04	-0,15	-2,94	1.728.527,66	0,31
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	13,21	0,05	-0,19	-3,82	2.059.133,91	0,37
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	12,34	0,07	-0,15	-3,01	3.203.764,54	0,57
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,25	12,11	0,24	-0,17	-3,43	11.794.703,09	2,11
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,35	11,29	0,15	-0,25	-5,18	7.798.467,35	1,40
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	21,46	12,25	0,13	-0,17	-3,47	6.523.176,32	1,17
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	21,78	11,24	0,16	-0,06	-1,14	8.873.898,64	1,59
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,25	14,30	0,07	-0,14	-2,88	2.846.563,36	0,51
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,61	15,73	0,24	-0,02	-0,20	8.856.003,23	1,59
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	22,88	15,04	-0,08	0,66	15,26	11.344.010,55	2,03
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	23,26	12,67	0,42	-0,07	-1,58	19.867.355,18	3,56
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,43	15,76	0,42	-0,07	-1,45	15.780.909,18	2,83
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,62	16,34	0,10	-0,16	-3,67	3.757.211,96	0,67
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,64	12,31	0,06	-0,14	-3,12	2.919.436,61	0,52
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	23,91	15,55	0,29	-0,06	-1,38	10.950.499,71	1,96
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	24,11	13,62	-0,04	0,62	15,16	9.874.072,22	1,77
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,93	16,56	0,14	-0,16	-3,92	5.136.367,00	0,92
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,37	13,00	-0,01	0,52	13,92	2.283.969,91	0,41
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	42,43	25,06	0,08	-0,19	-7,99	1.950.784,75	0,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 6,48% 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;