



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
NOVEMBRO 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 25.01.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

67,24%

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	12,30	1,92	1,24	2.432.513,09	0,43	260.441.934,04	0,93
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,02	1,29	5,91	3.098.997,08	0,54	1.330.163.090,56	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,74	1,96	1,22	3.340.094,38	0,58	380.050.993,13	0,88
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	44.389.649,26	7,77	5.721.224.105,90	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	1,17	66.643.276,04	11,66	5.938.047.265,27	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,53	0,70	2,66	9.667.781,45	1,69	1.160.833.344,04	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	25.205.508,99	4,41	19.732.912.783,40	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,73	2,49	-2,84	4.287.604,14	0,75	1.790.167.818,44	0,24
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,42	0,69	2,35	4.468.205,28	0,78	542.454.751,40	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	0,33	4,38	45.928,44	0,01	5.838.093.192,79	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,01	1,31	5,87	49.915.321,35	8,73	4.474.614.326,56	1,12
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,13	1,30	6,68	3.244.480,23	0,57	290.535.384,25	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,42	1,17	4,35	280.434,55	0,05	242.932.832,47	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	19.819.468,68	3,47	9.499.641.282,04	0,21
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	12.867.084,98	2,25	14.161.450.965,39	0,09
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,72	2,16	1,93	1.158.439,73	0,20	1.752.066.689,29	0,07
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,29	5,22	873.489,37	0,15	579.143.570,98	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	1,28	8,95	5.852.468,00	1,02	196.822.331,41	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,43	1,28	9,02	2.914.498,00	0,51	222.931.710,95	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,44	1,54	3,11	260.505.243,04	45,57		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,27	0,11	2,17	2.313.848,28	0,40	7.287.074.266,48	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,60	2,08	2,47	12.741.448,48	2,23	658.698.123,27	1,93
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	0,15	1,56	13.134.290,86	2,30	4.499.544.566,86	0,29
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,99	0,86	3,69	3.441.939,40	0,60	737.367.516,27	0,47
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	2,14	8.291.408,94	1,45	2.405.684.296,02	0,34
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,95	2,50	12,34	2.750.704,33	0,48	230.826.167,84	1,19
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,48	2,10	1,66	24.520.326,85	4,29	818.398.586,55	3,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,41	0,40	0,40	5.019.932,42	0,88	896.937.824,58	0,56
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,05	2,59	0,00	0,00	4.356.779.873,38	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,74	0,48	6,16	5.034.913,16	0,88	967.002.321,08	0,52
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,00	0,15	6,60	11.202.389,29	1,96	752.176.105,03	1,49
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,13	1,30	6,48	6.395.662,07	1,12	83.110.881,63	7,70
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,94	0,13	0,13	25.062.041,35	4,38	1.692.994.146,98	1,48
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1,33	0,23	0,26	2.005.140,82	0,35	526.032.249,99	0,38
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,78	0,89	3,26	121.914.046,25	21,33		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	INTRADER	PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	2,84	-0,18	-2,36	1.936.881,85	0,34	109.370.476,43	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,84	-0,18	-2,36	1.936.881,85	0,34		
Renda Fixa			7,67	1,32	3,07	384.356.171,14	67,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,02%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA IBOVESPA PLUS	45,14	15,87	-6,00	7.695.857,24	1,35	346.244.753,58	2,22
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,68	15,76	-5,95	13.457.042,09	2,35	688.588.931,64	1,95
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,82	15,80	-5,99	21.152.899,33	3,70		

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	44,11	13,69	-5,04	1.877.176,27	0,33	15.326.328,23	12,25
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	44,33	8,19	-10,73	9.861.630,91	1,73	767.879.921,64	1,28
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	48,10	17,23	-11,82	17.109.418,97	2,99	536.730.565,20	3,19
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,19	13,62	-14,49	10.028.837,08	1,75	984.415.780,43	1,02
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	41,93	16,03	-13,78	8.724.542,70	1,53	1.726.755.470,18	0,51
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,16	8,45	-9,67	20.057.210,84	3,51	2.027.456.710,01	0,99
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,57	13,75	-5,74	4.593.176,33	0,80	902.308.762,46	0,51
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	61,84	16,23	-33,55	2.535.480,07	0,44	498.385.691,73	0,51
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,03	8,68	2,51	8.217.921,56	1,44	2.456.975.630,65	0,33
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,99	14,74	-2,85	3.429.096,77	0,60	951.279.360,49	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	44,84	13,25	-7,16	2.907.609,49	0,51	1.073.948.321,63	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	46,38	8,63	-11,77	3.291.628,69	0,58	780.597.420,84	0,42
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,86	14,26	-5,78	2.448.720,14	0,43	912.327.763,54	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,69	15,73	-10,06	11.741.294,84	2,05	1.328.168.471,54	0,88
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,20	12,28	-10,51	9.497.078,13	1,66	3.450.221.666,13	0,28
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,67	13,92	-27,04	5.156.936,27	0,90	1.529.783.249,31	0,34
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	39,31	16,06	86,80	4.155.482,65	0,73	1.184.046.433,32	0,35
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,79	12,75	-10,70	125.633.241,71	21,98		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,78	10,58	9,23	10.735.885,11	1,88	647.909.280,33	1,66
Sub-total Artigo 8º III			32,78	10,58	9,23	10.735.885,11	1,88		

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	64,75	0,01	-1,95	848.450,73	0,15	14.745.453,20	5,75
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	484,21	-98,27	-98,82	10.416,92	0,00	61.323.689,95	0,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			113,55	-34,54	-47,29	858.867,65	0,15		

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	20,55	-0,37	-21,54	1.121.000,00	0,20	140.712.001,53	0,80
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	50,10	-0,86	-37,04	585.990,00	0,10	588.319.069,28	0,10
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	46,14	1,96	-27,63	95.734,91	0,02	15.335.692,09	0,62
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			36,05	-0,41	-27,66	1.802.724,91	0,32		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,49	12,60	-8,86	160.183.618,71	28,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,74%

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	28,85	2,79	53,22	4.331.411,47	0,76	142.560.197,78	3,04
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,15	3,60	72,11	15.073.652,06	2,64	1.165.879.862,43	1,29
Sub-total Artigo 9º A, II			28,75	3,43	67,82	19.405.063,53	3,39		

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	29,44	2,43	53,70	7.701.598,83	1,35	1.959.218.771,54	0,39
Sub-total Artigo 9º A, III			29,44	2,43	53,70	7.701.598,83	1,35		
Investimentos no Exterior			26,60	3,15	65,47	27.106.662,36	4,74		
Total			14,94	4,33	1,00	571.646.452,21	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	260.505.243,04	45,57	0,00	47,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	121.914.046,25	21,33	0,00	12,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.936.881,85	0,34	0,00	0,50	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	384.356.171,14	67,24				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	21.152.899,33	3,70	0,00	5,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	125.633.241,71	21,98	0,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	10.735.885,11	1,88	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	858.867,65	0,15	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.802.724,91	0,32	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	160.183.618,71	28,02				35,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	19.405.063,53	3,39	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	7.701.598,83	1,35	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.106.662,36	4,74				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

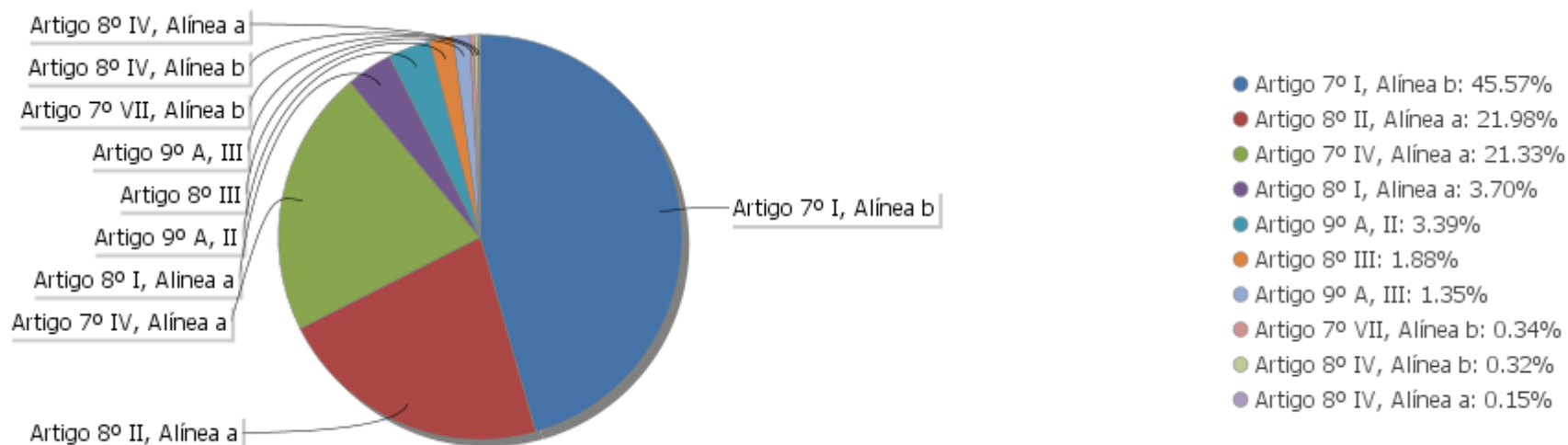
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,54 1.029,42	3,11 119,96	0,81 173,63	3,97 384,16	4,56 153,45	3.948.126,87	8.222.445,75
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,89 594,50	3,26 126,00	0,21 45,18	2,57 248,39	4,23 142,33	1.108.893,67	3.632.875,34
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,18 -117,57	-2,36 -91,20	-0,63 -135,09	-1,20 -116,41	-2,45 -82,44	-3.410,11	-47.534,24
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,80 -0,10	-5,99 -0,16	9,50 -0,09	24,25 -0,33	0,44 -0,17	2.886.065,74	-320.783,81
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,75 -3,16	-10,70 -4,87	5,53 -4,06	22,94 -1,65	-2,46 -3,07	14.109.521,27	-12.509.757,56
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	10,58 -5,32	9,23 15,07	2,87 -6,72	17,11 -7,48	12,10 11,49	1.027.615,32	1.185.092,10
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-34,54 -50,44	-47,29 -41,45	-34,64 -44,23	-43,02 -67,61	-44,99 -45,60	-100.536,74	-298.121,59
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,41 -16,31	-27,66 -21,82	-1,95 -11,54	2,39 -22,20	-18,49 -19,10	-7.435,56	-690.078,31
Artigo 9º A, II % do CDI	3,43 2.291,18	67,82 3.622,76	4,60 990,30	32,92 3.182,49		634.348,39	4.905.063,53
Artigo 9º A, III % do CDI	2,43 1.625,60	53,70 2.073,96	-1,39 -299,76	20,74 2.005,47	50,99 1.714,90	195.905,93	3.057.728,83
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						23.799.094,78	7.136.930,04

Análise de Liquidez

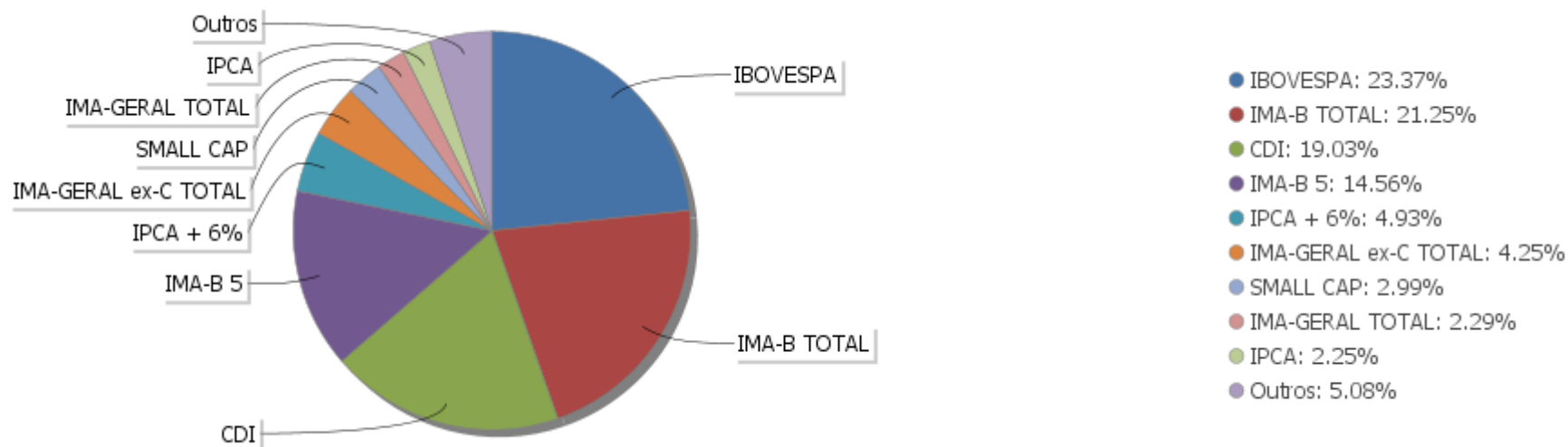
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	532.099.404,47	93,08	532.099.404,47	93,08
de 31 a 364 dias	26.500.426,09	4,64	558.599.830,56	97,72
acima de 365 dias	13.046.621,65	2,28	571.646.452,21	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

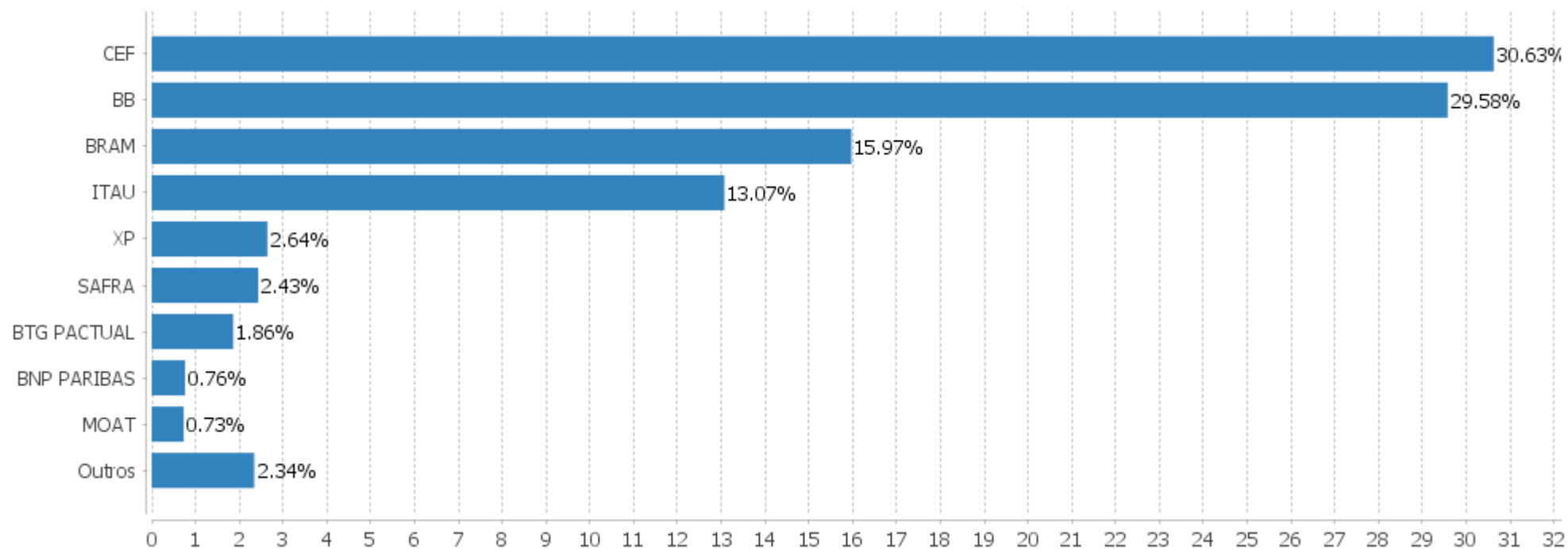


Alocação Por Estratégia



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	-1,89	-0,33	4,33		1,00
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35		8,61
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02	-1,20	-3,01	-1,67	2,98		-7,61
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

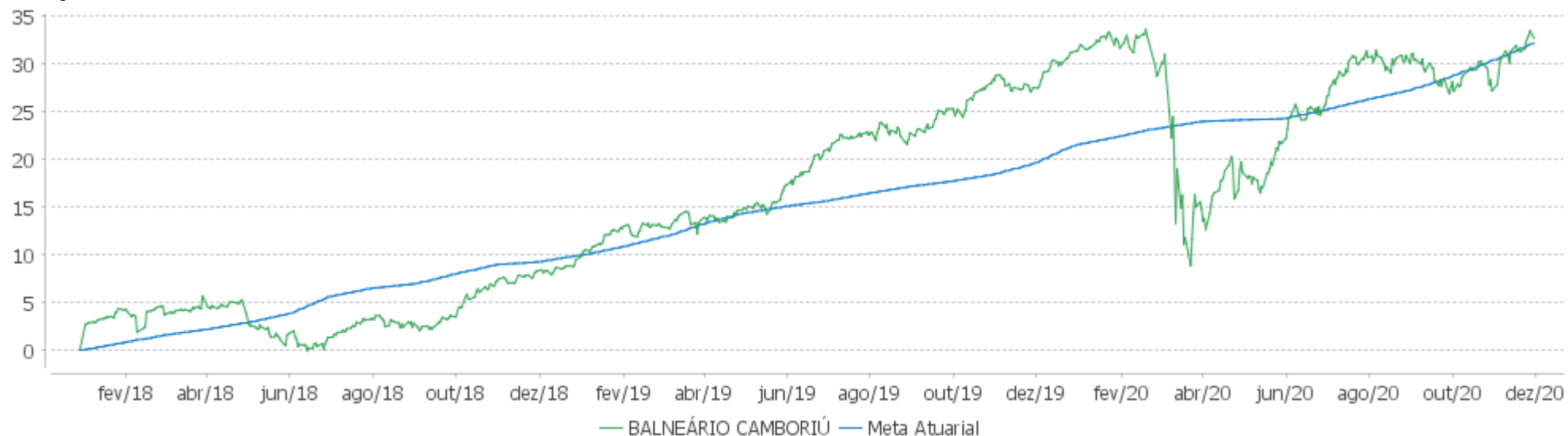
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

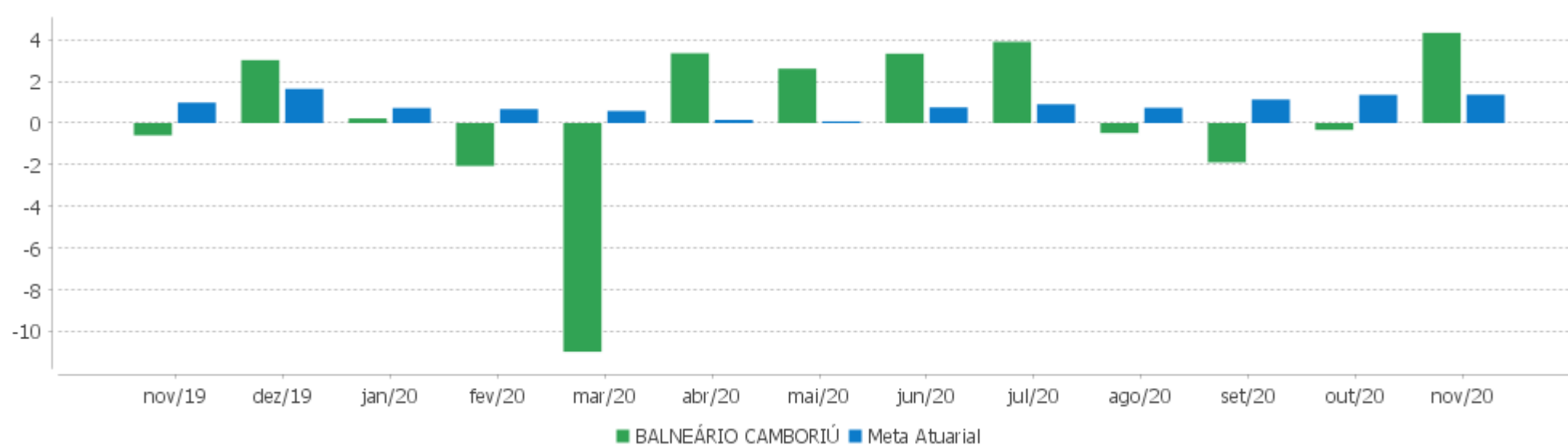
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	19	54,29	03 meses	2,01	3,86	-1,84	7,97
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	45,71	06 meses	9,00	6,30	2,69	7,57
			12 meses	4,06	10,40	-6,34	14,94
			24 meses	22,51	20,85	1,66	11,00
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,33	2020-11	Desde 29/12/2017	32,69	32,03	0,66	9,70
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
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,30 -0,02	5,97 -0,13	1,24 -0,16	3,77 -0,21	7,27 -0,13	21,30 -0,39	32,32 -0,74
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	2,10 1.401,79	1,66 64,15	0,51 109,97	5,35 516,86	3,74 125,87	28,41 307,50	45,39 278,39
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,11 75,73	2,17 83,99	0,19 41,74	0,72 69,57	2,54 85,54	8,60 93,06	15,41 94,52
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,15 103,54	2,05 79,00	0,27 58,73	0,91 88,15	2,40 80,86	8,40 90,87	15,20 93,21
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6% p.p.	1,30 -0,06	6,48 -2,26	0,61 -3,28	3,56 -2,81	8,01 -2,50	25,44 4,46	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	2,50 -0,08	-2,73 -0,86	0,05 -0,09	6,22 -0,30	-0,21 -0,89	28,70 -1,63	46,49 -2,31
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI	0,15 101,46	6,60 254,83	0,64 137,01	1,47 141,87	7,09 238,41	18,93 204,88	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,10 -0,79	2,65 -0,47	-0,05 -2,46	0,82 -2,48	3,01 -1,30	16,62 8,89	25,32 13,23
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	2,08 1.390,00	2,47 95,35	0,37 80,73	4,87 470,51	4,56 153,51	29,76 322,06	44,85 275,09
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,48 320,35	6,16 238,06	-0,82 -175,76	0,38 36,79	6,73 226,44	20,45 221,28	33,65 206,37
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 105,63	2,14 82,75	0,34 73,60	1,02 98,87	2,50 84,20	8,51 92,13	15,52 95,17
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF % do CDI	0,23 153,29	2,81 108,53	0,27 59,18	1,07 103,51	3,27 110,00		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,22 146,96	3,81 147,16	0,39 84,85	1,25 120,94	4,44 149,21		
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,86 0,12	3,69 0,44	0,42 0,20	2,74 0,38	4,65 0,48	18,43 0,58	29,97 0,66
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,70	6,68 5,20	1,43 0,76	4,28 -1,03	8,05 4,53	24,98 -1,85	37,78 -4,45
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,17 -0,32	0,62 -0,05	5,19 -0,12	3,18 -0,34	26,04 -0,79	41,07 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,29	5,82	1,31	3,83	7,10	21,07	32,11

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 5 p.p.	-0,03	-0,28	-0,09	-0,16	-0,31	-0,62	-0,96
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,29	5,91	1,31	3,82	7,20	21,13	31,90
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,03	-0,19	-0,08	-0,17	-0,21	-0,56	-1,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,31	5,87	1,35	3,81	7,13	21,12	32,19
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,23	-0,05	-0,18	-0,28	-0,57	-0,88
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	1,92	1,24	0,59	4,85	3,23	25,97	40,84
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,08	-0,24	-0,08	-0,46	-0,28	-0,86	-1,40
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,70	2,66	0,11	1,93	3,59	16,65	27,52
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,04	-0,59	-0,11	-0,42	-0,59	-1,20	-1,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,33	4,38	-0,64	0,43	5,02	18,30	30,60
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,27	-0,11	-0,15	-0,28	-0,74	-0,84
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,29	5,22	1,47	3,76	6,37	20,22	40,89
Var. INPC + 6% p.p.	-0,13	-4,36	-2,75	-3,20	-5,09	-1,90	6,89
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,28	8,95	3,51	5,71	10,42	20,43	33,26
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,08	0,22	-0,38	-0,66	-0,10	-0,56	-0,11
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	1,96	1,22	0,57	5,12	3,23	26,06	40,62
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,26	-0,10	-0,19	-0,28	-0,77	-1,61
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	2,16	1,93	-0,23	4,61	4,21	28,96	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,17	0,45	-0,90	-0,70	0,70	2,13	
BB PREV RF VII	1,17	4,35	1,86	3,69	5,31	16,61	27,51
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,83	2,87	1,19	-1,62	1,79	-10,22	-14,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,85	2,65	0,02	1,84	3,63	17,42	28,71
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,15	-0,02	0,04	-0,02	0,03	0,43	0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,82	5,27	0,20	1,37	5,90	24,20	33,20
Var. IPCA p.p.	-0,07	2,15	-2,20	-1,92	1,59	16,47	21,12
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	1,28	9,02	3,53	5,75	10,49	20,59	33,55
Var. INPC + 6% p.p.	-0,14	-0,56	-0,69	-1,22	-0,97	-1,53	-0,44
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,99	1,24	0,60	5,13	3,24	26,17	41,14
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,24	-0,07	-0,18	-0,27	-0,66	-1,09
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,69	2,35	-0,09	1,73	3,26	16,32	27,13
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01	-0,32	-0,07	-0,13	-0,34	-0,67	-0,97
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,49	-2,25	-0,01	6,20	0,41	29,47	47,47
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,09	-0,37	-0,15	-0,33	-0,27	-0,86	-1,33
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	-0,18	-2,36	-0,63	-1,20	-2,45	29,73	-4,55
% do CDI	-117,57	-91,20	-135,09	-116,41	-82,44	321,81	-27,90
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	15,76	-5,95	9,50	24,19	0,49	21,06	49,90

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.	-0,14	-0,11	-0,09	-0,39	-0,12	-0,60	-1,40
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	15,87	-6,13	9,50	24,36	0,35	21,10	50,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,03	-0,30	-0,09	-0,23	-0,26	-0,56	-0,66
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10,58	9,23	2,87	17,11	12,10	32,33	42,85
Var. IBOVESPA p.p.	-5,32	15,07	-6,72	-7,48	11,49	10,66	-8,45
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	1,96	-27,63	7,80	9,19	-40,57	-44,53	
Var. IFIX p.p.	0,45	-15,46	6,85	3,51	-37,74	-66,62	
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	-0,37	-21,54	-1,71	3,13	-17,13	19,93	
Var. IFIX p.p.	-1,88	-9,38	-2,66	-2,54	-14,31	-2,16	
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	-0,86	-37,04	-3,84	0,00	-15,84	19,71	
Var. IFIX p.p.	-2,37	-24,87	-4,79	-5,68	-13,01	-2,38	
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	17,23	-11,82	8,42	33,43	-0,84	36,45	54,54
Var. SMALL CAP p.p.	0,59	-4,22	0,64	0,04	-4,93	-12,79	-14,63
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	13,25	-7,16	2,14	16,87	1,24	31,11	82,59
Var. IBOVESPA p.p.	-2,65	-1,32	-7,44	-7,72	0,63	9,45	31,29
BRADESCO F I A SELECTION	8,19	-10,73	8,74	28,88	-4,31	14,22	51,90
Var. IBOVESPA p.p.	-7,71	-4,89	-0,85	4,29	-4,92	-7,45	0,60
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	13,92	-27,04	0,40	14,40	-19,60	5,77	35,90
Var. IBOVESPA p.p.	-1,98	-21,21	-9,18	-10,19	-20,21	-15,90	-15,40
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	14,74	-2,85	10,11	27,18	5,26	26,57	67,55
Var. IBOVESPA p.p.	-1,16	2,99	0,52	2,59	4,65	4,91	16,25
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	16,23	-28,67	4,02	20,93	-16,55	27,04	33,03
% do CDI	10.853,55	-1.107,18	865,06	2.023,52	-556,70	292,64	202,58
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,28	-10,51	7,24	25,78	-3,23	29,97	67,60
Var. IBOVESPA p.p.	-3,62	-4,67	-2,35	1,19	-3,84	8,31	16,30
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,26	-5,78	8,69	18,42	2,25	38,18	59,11
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,14	3,34	-1,13	-2,89	2,30	5,41	-1,41
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	13,69	-4,05	8,60	24,25	3,09	28,78	64,72
Var. IBRX 100 p.p.	-1,76	1,13	-0,97	-0,82	1,37	3,93	9,47
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	8,68	2,51	3,63	23,31	9,88	46,84	81,20
Var. IBOVESPA p.p.	-7,22	8,35	-5,95	-1,27	9,27	25,18	29,90
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	16,03	-13,78	9,16	16,86	-7,54	6,84	36,59
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,63	-4,65	-0,66	-4,44	-7,49	-25,93	-23,93
FIA CAIXA CONSUMO	8,63	-5,20	1,12	17,36	2,59	46,76	37,54
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,30	-1,22	-0,51	-1,26	-1,13	-2,08	-6,43
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	16,06	86,80	5,11	28,45			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,15	27,44	-4,48	3,86			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15,73	-10,06	6,25	29,26	1,22	41,06	56,65
Var. IBOVESPA p.p.	-0,17	-4,23	-3,33	4,67	0,61	19,39	5,35
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,75	-5,74	7,45	22,78	2,05	27,36	56,34
Var. IBOVESPA p.p.	-2,15	0,10	-2,13	-1,81	1,44	5,70	5,03
BB AÇÕES DIVIDENDOS	13,62	-14,49	6,71	17,29	-7,46	10,30	35,23
Var. IBOVESPA p.p.	-2,29	-8,65	-2,88	-7,30	-8,07	-11,36	-16,08
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	8,45	-9,67	0,45	16,10	-0,25	36,82	73,99
Var. IBOVESPA p.p.	-7,45	-3,83	-9,13	-8,49	-0,86	15,16	22,69
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	0,01	-1,95	0,14	-0,78	17,41	133,71	169,12
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,35	-10,69	-3,75	-7,15	6,89	112,72	135,75
FIP CAIXA CYRELA	-98,27	-98,82	-98,27	-98,69	-98,82	-98,91	
Var. IBOVESPA p.p.	-114,17	-92,98	-107,86	-123,28	-99,43	-120,58	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,79	73,34	0,63	23,54	69,77	114,38	
Var. IBOVESPA p.p.	-13,11	79,18	-8,96	-1,05	69,16	92,71	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,60	90,97	5,60	35,40	86,64		
Var. IPCA + 6% p.p.	2,24	82,24	1,71	29,03	76,12		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,43	53,70	-1,39	20,74	50,99	90,52	137,19
Var. IBOVESPA p.p.	-13,47	59,54	-10,98	-3,84	50,38	68,85	85,89
BALNEÁRIO CAMBORIÚ	4,33	1,00	2,01	9,00	4,06	22,51	
Var. IPCA + 6% p.p.	2,97	-7,73	-1,87	2,62	-6,46	1,53	
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
474	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	527.119,64	141.671,75037244	3,7207110000
475	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	463.638,27	124.610,12693542	3,7207110000
489	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	198.000,00	53.215,63539872	3,7207110000
476	05/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	115.338,91	30.997,29234722	3,7209350000
490	05/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.000,00	2.149,99724532	3,7209350000
491	06/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.686,88782619	3,7217780000
492	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	9.300,00	2.498,60494557	3,7220770000
493	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.800,00	483,60095721	3,7220770000
453	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.288,21	0,00	20.619,68063900	2,2933531720
477	11/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	134.738,35	0,00	36.199,31791633	3,7221240000
478	16/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.040.671,29	0,00	279.532,65696043	3,7228970000
450	16/11/2020	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	0,00	158.844,33	67.828,20957500	2,3418623460
479	17/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	300.000,00	80.574,74502793	3,7232510000
480	17/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	100.000,00	26.858,24834264	3,7232510000
451	17/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	158.854,78	0,00	69.242,27274100	2,2941878380
454	17/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.190,94	0,00	26.672,15778300	2,2941878380
472	17/11/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	25.128.909,01	1.397.657,18513749	17,9793080000
481	18/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.300.000,00	349.143,25616372	3,7234000000
494	18/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.000,00	805,71520653	3,7234000000
499	18/11/2020	FIA CAIXA CONSUMO	100.000,00	0,00	49.015,61931725	2,0401660000
452	18/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500.000,00	217.930,79753300	2,2943062920
455	18/11/2020	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	200.000,00	16.518,69754266	12,1074921000
502	18/11/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	2.000.000,00	390.402,73014790	5,1229150000
458	18/11/2020	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.000.000,00	0,00	2.490.462,52471535	2,0076592000
459	18/11/2020	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	5.000.000,00	3.013.214,08880075	1,6593577000
460	18/11/2020	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	100.000,00	0,00	61.428,19320641	1,6279170000
461	18/11/2020	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	100.000,00	0,00	61.428,19320641	1,6279170000
464	18/11/2020	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	100.000,00	0,00	51.053,20203130	1,9587410000

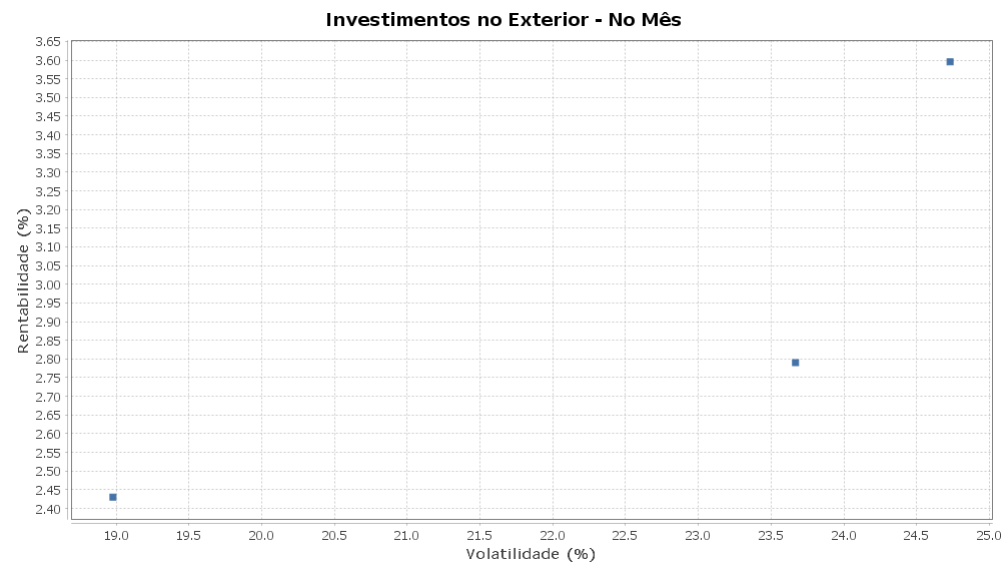
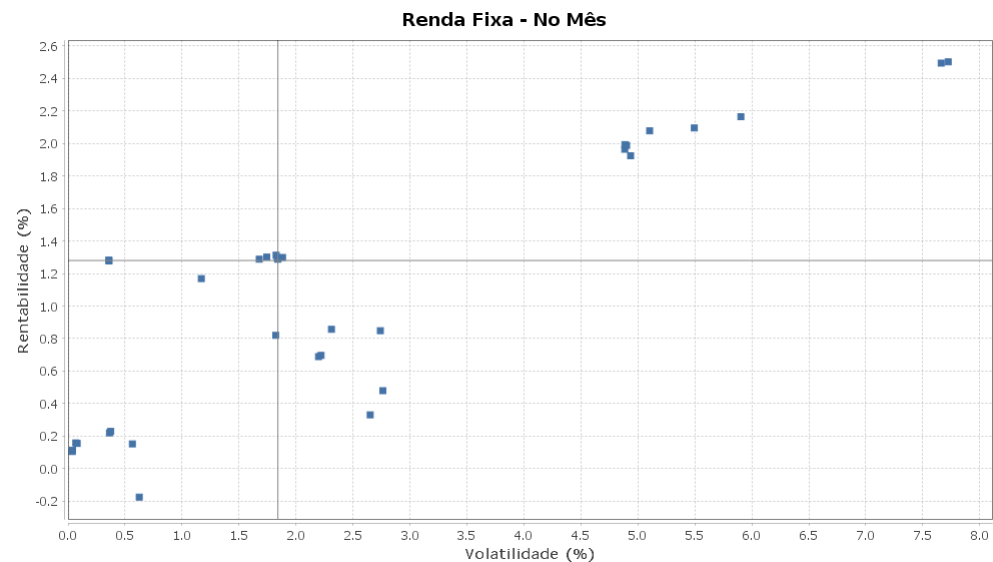
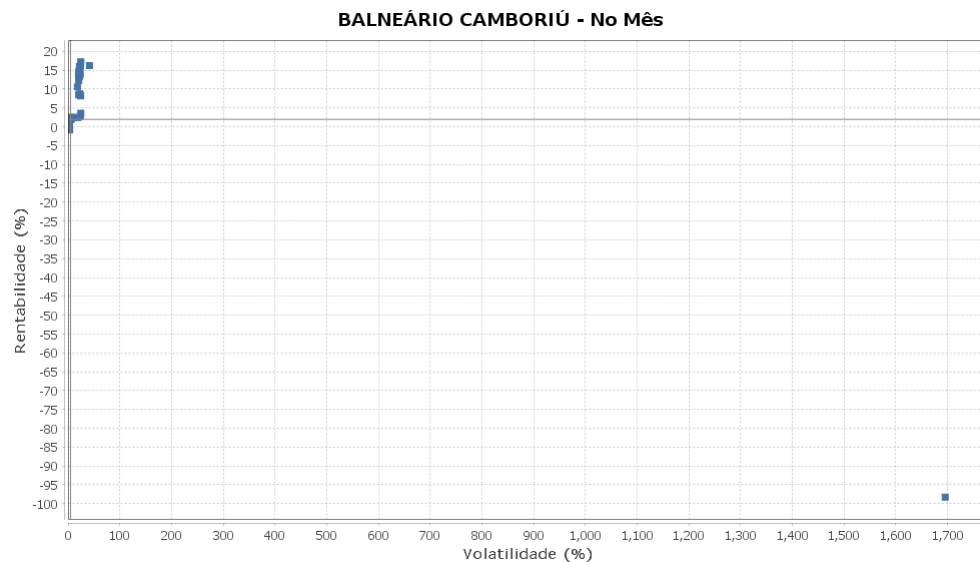
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
466	18/11/2020	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	100.000,00	0,00	25.838,69430256	3,8701646000
469	18/11/2020	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1.000.240,52	0,00	95.148,12903854	10,5124560000
470	18/11/2020	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	24.028.668,49	0,00	2.285.733,08558913	10,5124560000
473	19/11/2020	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	581,43739663	859,9378074000
482	19/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.647.806,19	0,00	1.248.180,87507358	3,7236640000
500	19/11/2020	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	100.000,00	0,00	21.383,11779300	4,6765865000
501	19/11/2020	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	100.000,00	0,00	34.231,78065000	2,9212620000
456	19/11/2020	BRADESCO F I A SELECTION	100.000,00	0,00	112,03513392	892,5771452000
457	19/11/2020	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	100.000,00	0,00	9.686,27820616	10,3238827000
465	19/11/2020	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	100.000,00	0,00	33.813,79809903	2,9573726000
467	19/11/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	5.227,85082551	191,2831933000
483	20/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.057.610,53	0,00	284.009,05565244	3,7238620000
484	23/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.000.000,00	0,00	537.046,40054048	3,7240730000
485	23/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	11.045,08	2.965,86022884	3,7240730000
495	23/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	66.910,56	17.967,03770307	3,7240730000
486	25/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	94.050,00	25.249,84730621	3,7247750000
496	25/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	70.728,96	18.988,78724218	3,7247750000
487	26/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.558.745,67	955.317,69871975	3,7251960000
497	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	30.000,00	8.052,35101809	3,7256200000
488	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	13.000,00	3.489,08707500	3,7259030000
498	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.406,63	377,52727325	3,7259030000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 20.180.861,85

Value-At-Risk: 3,53%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GÂVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,00	-7,10	0,01	848.450,73	0,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	NaN	0,00	-1,23	0,10	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,10	0,00	-0,91	0,11	2.313.848,28	0,40
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,12	0,16	8.291.408,94	1,45
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,13	0,00	0,07	0,15	13.134.290,86	2,30
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,36	0,09	0,00	3,16	1,28	2.914.498,00	0,51
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,36	0,09	0,00	3,14	1,28	5.852.468,00	1,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,36	0,25	0,00	0,19	0,22	25.062.041,35	4,38
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,37	0,24	0,00	0,21	0,23	2.005.140,82	0,35
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,56	0,27	-0,00	0,00	0,15	11.202.389,29	1,96
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,62	0,06	0,00	-0,52	-0,18	1.936.881,85	0,34
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	0,90	0,00	0,87	1,17	280.434,55	0,05
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	1,32	0,11	0,00	-0,39	-0,37	1.121.000,00	0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,08	0,00	0,68	1,29	873.489,37	0,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	1,11	0,00	0,66	1,30	3.244.480,23	0,57
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,02	0,37	0,82	12.867.084,98	2,25
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,83	0,99	0,05	0,64	1,31	49.915.321,35	8,73
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,84	1,08	0,01	0,63	1,30	5.019.932,42	0,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,03	0,62	1,29	25.205.508,99	4,41
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,02	0,00	0,62	1,29	3.098.997,08	0,54
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	1,88	1,42	0,01	0,61	1,30	6.395.662,07	1,12
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,20	1,11	0,01	0,25	0,69	4.468.205,28	0,78
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,12	0,01	0,25	0,70	9.667.781,45	1,69
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,31	1,14	0,00	0,31	0,86	3.441.939,40	0,60
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,65	1,34	0,00	0,07	0,33	45.928,44	0,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,03	0,25	0,85	19.819.468,68	3,47
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,76	1,43	0,01	0,12	0,48	5.034.913,16	0,88
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	3,08	0,24	0,00	-0,33	-0,86	585.990,00	0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	2,66	0,01	0,37	1,96	3.340.094,38	0,58
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,15	0,38	1,99	44.389.649,26	7,77
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,22	0,38	1,99	66.643.276,04	11,66
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,94	2,65	0,01	0,36	1,92	2.432.513,09	0,43
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,10	2,86	0,05	0,38	2,08	12.741.448,48	2,23
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,50	2,86	0,09	0,35	2,10	24.520.326,85	4,29
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	5,52	1,15	-0,00	0,33	1,96	95.734,91	0,02
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,90	3,30	0,00	0,34	2,16	1.158.439,73	0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,66	4,12	0,02	0,31	2,49	4.287.604,14	0,75
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,72	4,13	0,01	0,30	2,50	2.750.704,33	0,48
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	18,18	8,25	0,10	0,57	10,58	10.735.885,11	1,88
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	18,98	12,80	0,05	0,12	2,43	7.701.598,83	1,35
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	20,01	9,78	0,08	0,68	13,75	4.593.176,33	0,80
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,47	11,01	0,36	0,41	8,45	20.057.210,84	3,51
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	20,53	10,21	0,16	0,59	12,28	9.497.078,13	1,66
BRADESCO FI AÇÕES INSTITUCIONAL IBX ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	20,55	10,06	0,03	0,66	13,69	1.877.176,27	0,33
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,79	9,69	0,04	0,68	14,26	2.448.720,14	0,43
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,93	10,67	0,06	0,70	14,74	3.429.096,77	0,60
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,05	9,69	0,16	0,64	13,62	10.028.837,08	1,75
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,86	10,40	0,05	0,60	13,25	2.907.609,49	0,51
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,94	10,99	0,15	0,72	16,03	8.724.542,70	1,53
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,32	10,55	0,23	0,70	15,76	13.457.042,09	2,35
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	22,47	10,62	0,13	0,70	15,87	7.695.857,24	1,35
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,54	10,22	0,14	0,38	8,68	8.217.921,56	1,44
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	22,78	11,74	0,06	0,37	8,63	3.291.628,69	0,58
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	10,78	0,20	0,68	15,73	11.741.294,84	2,05
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	23,67	12,12	0,02	0,11	2,79	4.331.411,47	0,76
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	23,76	13,18	0,11	0,58	13,92	5.156.936,27	0,90
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,05	11,81	0,08	0,66	16,06	4.155.482,65	0,73
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	24,37	10,95	0,17	0,33	8,19	9.861.630,91	1,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	24,70	11,27	0,31	0,69	17,23	17.109.418,97	2,99
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,73	14,63	0,02	0,14	3,60	15.073.652,06	2,64
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	41,28	17,86	0,06	0,39	16,23	2.535.480,07	0,44
FIP CAIXA CYRELA	Artigo 8º IV, Alínea a	1.695,32	21,93	0,00	-0,06	-98,27	10.416,92	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 5,75% 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;