



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
JANEIRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.01.2021.

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 67,33%

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	12,36	-0,88	-0,88	2.528.486,30	0,42	266.953.517,36	0,95
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,04	0,08	0,08	3.157.694,34	0,53	1.538.309.557,84	0,21
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,79	-0,88	-0,88	3.470.759,68	0,58	403.585.829,79	0,86
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	46.134.299,86	7,74	8.335.200.025,45	0,55
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	69.259.513,01	11,62	6.185.705.380,20	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,58	-0,46	-0,46	9.826.349,13	1,65	1.190.995.528,69	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	25.406.841,01	4,26	13.518.203.391,91	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-1,70	-1,70	4.529.932,79	0,76	1.607.704.843,41	0,28
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,47	-0,45	-0,45	4.542.643,73	0,76	538.951.232,05	0,84
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	33.994,10	0,01	2.465.176.454,79	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,04	0,10	0,10	50.866.250,03	8,53	5.043.806.710,80	1,01
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,12	0,13	0,13	3.302.675,67	0,55	295.746.645,48	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	2,45	0,29	0,29	284.631,89	0,05	246.568.875,27	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	20.178.901,64	3,39	9.495.985.226,13	0,21
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	13.040.313,02	2,19	14.822.912.413,17	0,09
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,81	-1,67	-1,67	1.202.458,87	0,20	1.731.335.032,19	0,07
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,22	0,15	0,15	888.904,42	0,15	589.364.098,33	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,47	1,33	1,33	6.030.196,00	1,01	202.799.433,76	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,47	1,34	1,34	3.003.352,00	0,50	229.728.165,07	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,48	-0,42	-0,42	267.688.197,49	44,91		

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	0,15	0,15	4.355.463,66	0,73	6.620.047.656,58	0,07

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	14,66	-1,05	-1,05	13.229.706,99	2,22	641.898.631,44	2,06
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,18	0,17	0,17	1.572.725,52	0,26	19.956.791.600,04	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,16	0,16	17.121.806,44	2,87	5.006.506.249,23	0,34
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	6,04	-0,25	-0,25	3.504.689,25	0,59	763.158.290,49	0,46
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,22	0,17	0,17	8.420.255,62	1,41	2.962.335.860,83	0,28
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	20,07	-1,67	-1,67	2.906.317,63	0,49	217.913.983,39	1,33
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,58	-1,11	-1,11	25.521.244,96	4,28	778.748.176,57	3,28
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,44	-0,02	-0,02	5.108.139,12	0,86	1.002.679.832,30	0,51
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,84	-0,84	-0,84	5.090.154,82	0,85	606.033.486,21	0,84
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	2,00	-0,28	-0,28	11.182.727,30	1,88	736.808.414,91	1,52
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6,14	0,02	0,02	6.522.298,31	1,09	84.756.504,71	7,70
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,93	-0,12	-0,12	25.105.537,66	4,21	2.221.756.842,04	1,13
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1,36	-0,28	-0,28	2.011.768,68	0,34	526.420.120,98	0,38
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,81	-0,41	-0,41	131.652.835,96	22,09		

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	2,85	0,70	0,70	1.947.439,17	0,33	109.879.989,78	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,85	0,70	0,70	1.947.439,17	0,33		
Renda Fixa			7,70	-0,41	-0,41	401.288.472,62	67,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,72%

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	45,49	-3,34	-3,34	8.129.862,68	1,36	343.187.799,40	2,37
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	45,03	-3,32	-3,32	14.212.633,31	2,38	761.516.224,91	1,87
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,17	-3,33	-3,33	22.342.495,99	3,75		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	44,62	-2,48	-2,48	10.377.163,29	1,74	781.607.838,45	1,33
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	48,45	-4,70	-4,70	17.433.144,97	2,92	525.556.577,31	3,32
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,53	-4,39	-4,39	10.324.026,67	1,73	998.958.997,80	1,03
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	42,34	-4,28	-4,28	9.138.324,41	1,53	1.728.171.065,55	0,53
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,46	-2,67	-2,67	21.201.537,64	3,56	2.134.082.790,72	0,99
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,91	-2,34	-2,34	4.861.131,85	0,82	945.642.826,43	0,51
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	62,70	-7,07	-7,07	2.460.797,19	0,41	464.891.622,20	0,53
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,58	-0,62	-0,62	8.594.849,72	1,44	2.721.146.302,78	0,32
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	45,26	-1,88	-1,88	3.660.685,36	0,61	983.619.225,02	0,37
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	45,12	-4,25	-4,25	3.100.102,86	0,52	1.124.223.357,95	0,28
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	46,82	-1,37	-1,37	3.405.008,09	0,57	707.827.403,93	0,48
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,22	-3,76	-3,76	2.577.455,75	0,43	968.458.637,18	0,27
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,99	-3,48	-3,48	12.194.059,88	2,05	1.192.287.997,72	1,02
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	43,04	-2,17	-2,17	97.825,68	0,02	2.190.224.065,15	0,00
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,50	-1,46	-1,46	9.947.161,32	1,67	3.479.599.111,95	0,29
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	53,08	-2,91	-2,91	5.406.098,63	0,91	1.335.473.423,07	0,40
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	36,45	-6,26	-6,26	4.169.843,91	0,70	1.174.738.305,29	0,35
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			45,07	-3,25	-3,25	128.949.217,22	21,63		

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	33,03	-0,18	-0,18	11.045.820,51	1,85	760.076.567,11	1,45
Sub-total Artigo 8º III			33,03	-0,18	-0,18	11.045.820,51	1,85		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GAVEA	GAVEA	GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	25,65	0,48	0,48	1.097.888,36	0,18	18.994.857,33	5,78
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	485,23	-7,59	-7,59	8.780,02	0,00	508.639,17	1,73
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			115,06	0,41	0,41	1.106.668,38	0,19		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO THE ONE	16,90	-0,53	-0,53	1.117.960,00	0,19	146.231.801,97	0,76
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	31,87	1,08	1,08	579.096,00	0,10	730.601.750,67	0,08
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	39,27	2,76	2,76	66.927,50	0,01	11.507.603,06	0,58
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			20,64	0,12	0,12	1.763.983,50	0,30		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,77	-3,00	-3,00	165.208.185,60	27,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,95%

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	29,91	3,98	3,98	4.572.644,28	0,77	189.714.982,18	2,41
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,19	0,26	0,26	1.002.649,73	0,17	509.817.134,66	0,20
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,10	4,30	4,30	15.749.815,45	2,64	1.477.834.874,26	1,07
Sub-total Artigo 9º A, II			27,64	4,15	4,15	21.325.109,46	3,58		

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	30,33	5,79	5,79	8.203.800,76	1,38	2.159.778.426,35	0,38
Sub-total Artigo 9º A, III			30,33	5,79	5,79	8.203.800,76	1,38		
Investimentos no Exterior			27,61	4,64	4,64	29.528.910,22	4,95		
Total			15,06	-0,91	-0,91	596.025.568,44	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	267.688.197,49	44,91	0,00	52,11	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	131.652.835,96	22,09	0,00	11,45	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.947.439,17	0,33	0,00	0,35	5,00	10,00
	Total Renda Fixa	401.288.472,62	67,33				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	22.342.495,99	3,75	0,00	2,00	30,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	128.949.217,22	21,63	0,00	19,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	11.045.820,51	1,85	0,00	4,55	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.106.668,38	0,19	0,00	0,20	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.763.983,50	0,30	0,00	0,34	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	165.208.185,60	27,72				35,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	21.325.109,46	3,58	0,00	5,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.203.800,76	1,38	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	29.528.910,22	4,95				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

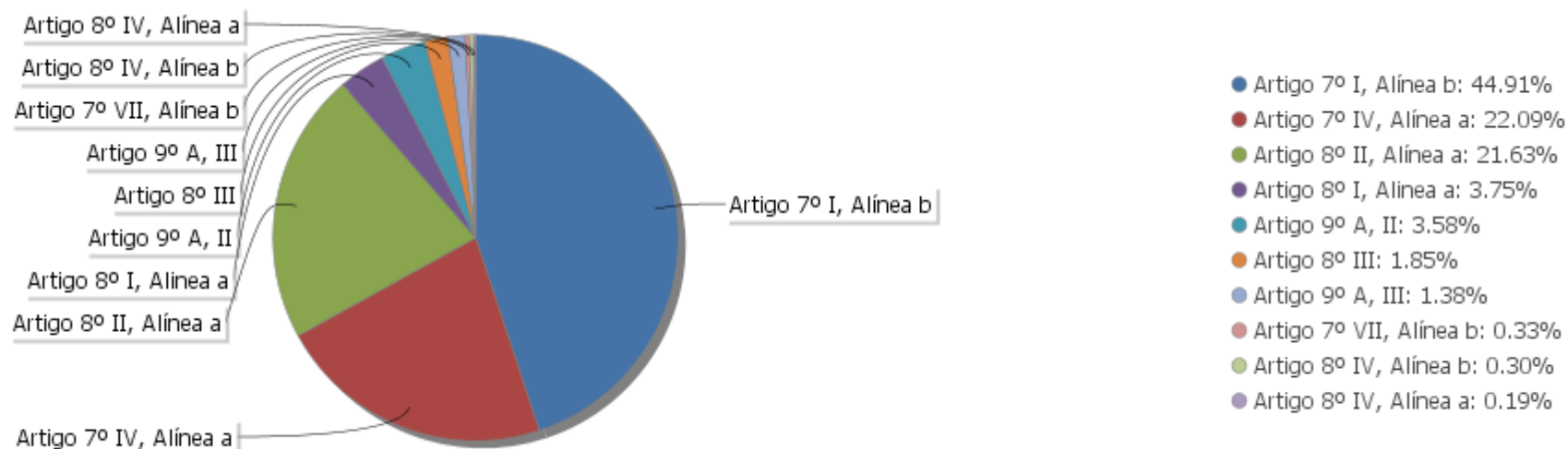
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,42 -283,59	-0,42 -283,59	4,45 959,16	2,70 287,05	5,58 220,93	-1.139.663,40	-1.139.663,40
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,41 -271,84	-0,41 -271,84	2,68 576,62	1,30 137,77	4,69 185,82	-540.756,59	-540.756,59
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,70 470,63	0,70 470,63	0,37 79,36	-0,22 -23,75	-1,06 -42,14	13.605,39	13.605,39
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,33 -0,01	-3,33 -0,01	22,31 -0,16	11,67 -0,14	0,98 -0,17	-769.450,42	-769.450,42
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 0,07	-3,25 0,07	17,42 -5,06	7,49 -4,32	-7,01 -8,16	-4.331.927,87	-4.331.927,87
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,18 3,14	-0,18 3,14	13,78 -8,70	13,09 1,28	11,97 10,82	-19.443,46	-19.443,46
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,41 3,73	0,41 3,73	-15,65 -38,13	-15,85 -27,66	-34,35 -35,50	4.551,35	4.551,35
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,12 3,44	0,12 3,44	-2,52 -25,00	-1,45 -13,26	-15,90 -17,05	2.075,98	2.075,98
Artigo 9º A, II % do CDI	4,15 2.777,41	4,15 2.777,41	8,23 1.774,12	25,92 2.754,92		827.222,17	827.222,17
Artigo 9º A, III % do CDI	5,79 3.871,18	5,79 3.871,18	9,11 1.962,59	20,97 2.228,15	53,70 2.126,48	448.786,63	448.786,63
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						-5.505.000,22	-5.505.000,22

Análise de Liquidez

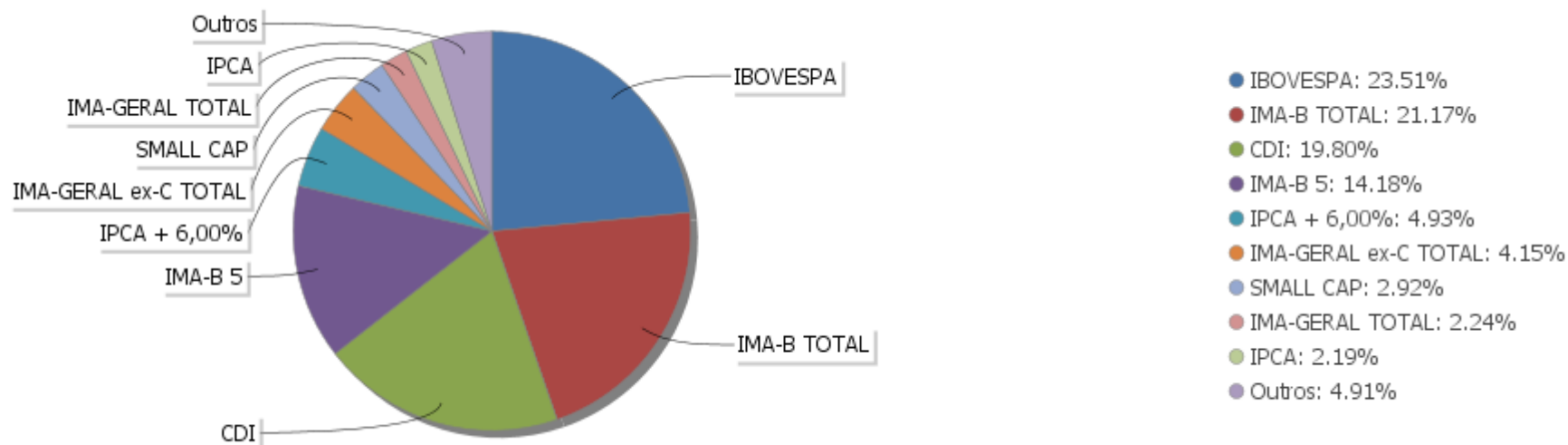
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	546.077.521,59	91,62	546.077.521,59	91,62
de 31 a 365 dias	33.384.179,32	5,60	579.461.700,91	97,22
acima de 365 dias	16.563.867,53	2,78	596.025.568,44	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

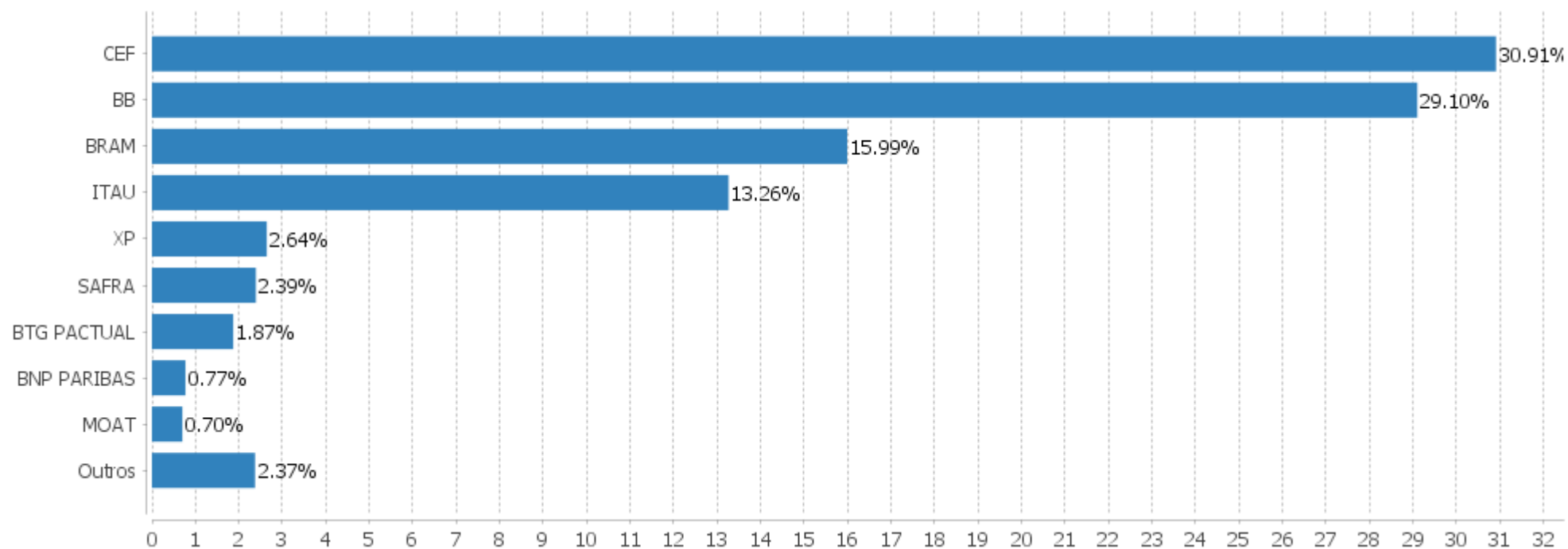


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,91												-0,91
IPCA + 5,42%	0,67												0,67
p.p. indexador	-1,59												-1,59
2020	0,22	-2,06	-10,98	3,35	2,61	3,33	3,90	-0,48	-1,89	-0,33	4,33	4,11	5,16
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02	-1,20	-3,01	-1,67	2,98	2,26	-5,47
2019	2,76	0,29	0,45	1,18	2,10	3,07	1,36	0,18	2,07	2,37	-0,59	3,02	19,76
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,92	-0,61	-0,75	0,12	1,45	2,62	0,64	-0,44	1,63	1,74	-1,57	1,38	9,17
2018	4,20	0,36	1,03	-1,67	-2,24	-0,22	1,97	-0,52	0,71	3,59	1,00	1,28	9,70
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,40	-0,38	0,45	-2,38	-3,13	-1,97	1,13	-0,96	-0,21	2,63	0,75	0,67	-0,22

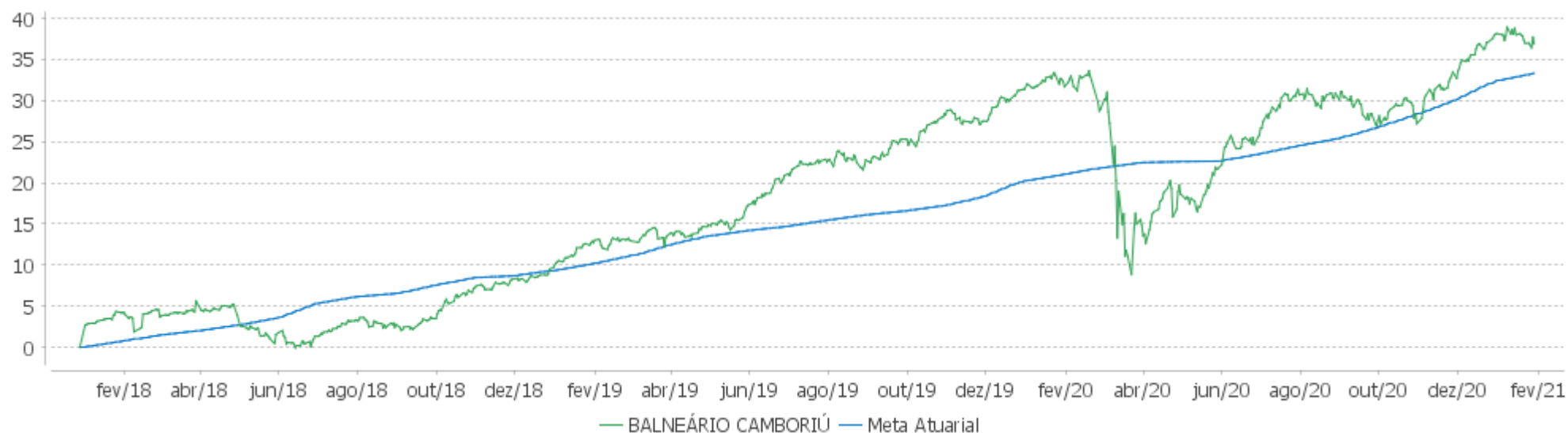
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

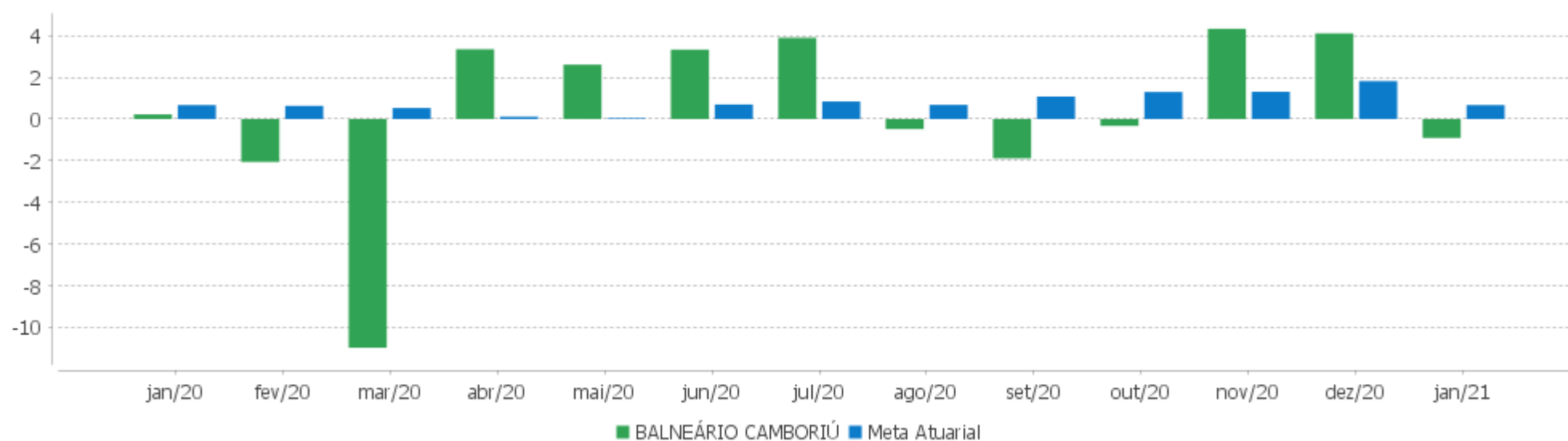
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	54,05	03 meses	7,63	3,92	3,71	6,50
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	45,95	06 meses	4,73	7,26	-2,52	7,18
			12 meses	3,96	10,58	-6,62	15,06
			24 meses	21,44	22,15	-0,71	11,10
			36 meses	31,37	34,30	-2,93	9,55
			Desde 29/12/2017	36,89	35,38	1,51	9,53
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,33	2020-11					
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.	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	3,08 -0,21	3,45 -0,35	7,24 -0,32	19,88 -0,65	31,75 -0,94
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	-1,11 -741,14	-1,11 -741,14	6,26 1.349,37	2,47 262,35	5,42 214,49	25,62 302,94	44,47 289,26
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,15 101,47	0,15 101,47	0,47 102,19	0,70 74,58	2,18 86,19	7,90 93,44	14,57 94,79
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,16 108,14	0,16 108,14	0,68 146,62	0,95 100,44	2,20 87,20	7,87 93,11	14,55 94,64
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,02 -0,70	0,02 -0,70	3,30 -0,68	3,27 -4,09	7,87 -2,88	22,92 0,57	48,08 13,55
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,67 0,02	-1,67 0,02	8,30 -0,13	1,77 -0,24	2,81 -0,88	25,26 -1,57	46,45 -2,24
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI	-0,28 -189,48	-0,28 -189,48	-0,02 -5,19	0,85 90,12	6,24 247,21	16,68 197,31	
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,05 -705,19	-1,05 -705,19	5,99 1.290,45	2,22 236,39	6,18 244,63	26,80 316,92	44,28 288,00
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,84 -564,95	-0,84 -564,95	1,58 340,69	-0,12 -12,74	6,32 250,19	18,27 216,00	32,27 209,87
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,17 110,47	0,17 110,47	0,58 124,04	0,94 100,20	2,21 87,55	7,89 93,26	14,67 95,44
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF % do CDI	-0,28 -186,06	-0,28 -186,06	0,56 120,75	0,67 71,56	2,64 104,47		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	-0,12 -77,25	-0,12 -77,25	0,39 84,81	0,69 73,35	3,66 145,10		
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,17 110,92	0,17 110,92	0,50 107,94	0,78 83,01	2,28 90,21	8,04 95,09	14,76 96,02
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,25 -0,00	-0,25 -0,00	2,69 0,17	1,62 0,23	4,98 0,48	16,92 0,59	28,83 0,64
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,70 470,63	0,70 470,63	0,37 79,36	-0,22 -23,75	-1,06 -42,14	30,91 365,51	-3,68 -23,97
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,13 0,99	0,13 0,99	3,12 -2,92	3,73 0,95	7,85 2,62	22,55 -1,74	36,17 -5,66
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,87	-0,87	5,99	2,66	4,88	23,46	40,68

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.	-0,02	-0,02	-0,05	-0,12	-0,35	-0,82	-1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,08	3,22	3,64	7,25	19,86	31,74
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,02	-0,07	-0,16	-0,30	-0,66	-0,94
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,08	0,08	3,21	3,65	7,33	20,00	31,56
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,02	-0,07	-0,15	-0,22	-0,52	-1,12
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,10	0,10	3,24	3,66	7,29	19,97	31,81
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,15	-0,27	-0,56	-0,87
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	-0,88	-0,88	5,95	2,67	4,98	23,49	40,49
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,09	-0,11	-0,25	-0,80	-1,33
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,15	0,15	3,08	3,70	6,62	18,65	40,83
Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,59	-0,59	-1,11	-4,27	-5,16	-4,97	5,18
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,46	-0,46	2,35	1,02	3,84	15,02	26,37
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,21	-0,21	-0,18	-0,37	-0,66	-1,30	-1,82
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,77	-0,77	1,51	-0,25	4,73	16,38	28,81
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,03	0,03	0,01	-0,10	-0,18	-0,57	-0,80
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,33	1,33	4,35	7,48	10,80	22,64	34,92
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,62	0,62	0,36	0,12	0,05	0,29	0,39
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	-1,67	-1,67	6,05	1,46	5,43	24,74	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,82	-0,82	0,01	-1,31	0,20	0,46	
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	-0,88	-0,88	5,95	2,61	4,93	23,58	40,27
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,02	-0,09	-0,17	-0,30	-0,71	-1,56
BB PREV RF VII	0,29	0,29	2,68	3,87	5,71	15,45	26,97
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14	1,14	-3,36	1,09	0,48	-8,84	-14,86
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,55	-0,55	2,68	0,93	4,00	15,84	27,67
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,11	-0,11	0,29	-0,03	0,14	0,48	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,03	0,03	2,18	0,99	5,82	20,75	32,60
Var. IPCA p.p.	-0,22	-0,22	-0,33	-3,31	1,27	11,80	19,54
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,86	-0,86	6,00	2,62	4,95	23,66	40,75
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,16	-0,27	-0,63	-1,07
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	1,34	1,34	4,37	7,51	10,88	22,81	35,21
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,60	0,60	0,19	-0,46	-0,91	-0,82	-0,44
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,45	-0,45	2,37	0,84	3,56	14,76	26,02
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,02	-0,12	-0,30	-0,60	-0,93
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,70	-1,70	8,29	1,74	3,23	26,02	47,40
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,01	-0,01	-0,14	-0,27	-0,45	-0,81	-1,29
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-0,18	-0,18	13,78	13,09	11,97	37,87	37,07

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.	3,14	3,14	-8,70	1,28	10,82	19,73	1,56
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,26	11,68	1,02	17,63	34,23
Var. IBOVESPA p.p.	-0,00	-0,00	-0,21	-0,13	-0,13	-0,51	-1,28
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-3,34	-3,34	22,40	11,66	0,84	17,52	34,83
Var. IBOVESPA p.p.	-0,03	-0,03	-0,07	-0,15	-0,31	-0,63	-0,68
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	-4,70	-4,70	19,45	8,87	-10,49	25,24	41,09
Var. SMALL CAP p.p.	-1,27	-1,27	-1,66	-1,66	-5,99	-13,47	-16,19
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-4,25	-4,25	20,75	5,77	1,31	24,49	65,96
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-0,93	-1,72	-6,04	0,17	6,34	30,45
BRADESCO FIA SELECTION	-2,48	-2,48	13,85	13,11	-4,84	13,16	33,95
Var. IBOVESPA p.p.	0,84	0,84	-8,62	1,30	-5,98	-4,98	-1,56
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-1,88	-1,88	22,49	13,88	4,32	26,25	52,35
Var. IBOVESPA p.p.	1,44	1,44	0,02	2,06	3,17	8,10	16,84
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-2,91	-2,91	19,42	1,12	-24,63	-1,24	25,09
Var. IBOVESPA p.p.	0,41	0,41	-3,05	-10,69	-25,77	-19,38	-10,42
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-7,07	-7,07	12,80	-7,12	-33,20	5,22	17,32
% do CDI	-4.730,13	-4.730,13	2.758,08	-756,16	-1.314,70	61,74	112,65
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,46	-1,46	17,60	12,10	-6,09	23,46	49,45
Var. IBOVESPA p.p.	1,85	1,85	-4,88	0,29	-7,24	5,31	13,93
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,76	-3,76	20,27	10,03	-2,32	25,54	47,60
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,32	1,32	1,97	1,95	2,19	4,27	3,65
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-0,62	-0,62	13,66	7,92	5,08	38,70	67,53
Var. IBOVESPA p.p.	2,70	2,70	-8,81	-3,89	3,93	20,56	32,02
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	-4,28	-4,28	21,53	8,42	-7,17	3,03	21,51
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,80	0,80	3,24	0,34	-2,65	-18,24	-22,44
FIA CAIXA CONSUMO	-1,37	-1,37	12,37	2,94	-5,14	35,42	31,21
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,09	-0,09	-0,53	-0,85	-1,15	-2,15	-6,63
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-6,26	-6,26	16,46	1,60			
Var. IBOVESPA p.p.	-2,94	-2,94	-6,02	-10,21			
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-2,04	-2,04	18,77	10,41	1,79	28,75	60,11
Var. IBOVESPA p.p.	1,28	1,28	-3,71	-1,40	0,64	10,60	24,60
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-3,48	-3,48	20,19	8,82	-7,06	31,28	45,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	-0,16	-2,28	-2,99	-8,21	13,14	9,64
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-2,34	-2,34	20,39	10,30	-0,91	22,60	42,55
Var. IBOVESPA p.p.	0,98	0,98	-2,09	-1,52	-2,06	4,46	7,04
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,39	-4,39	16,96	6,10	-11,60	4,52	20,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,07	-1,07	-5,51	-5,71	-12,75	-13,63	-15,13
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 0,65	-2,67 0,65	14,64 -7,84	4,51 -7,31	-6,04 -7,19	27,57 9,42	61,16 25,65
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,48 -0,23	0,48 -0,23	29,41 25,42	29,60 22,24	27,63 16,87	45,85 23,50	221,54 187,02
FIP CAIXA CYRELA Var. IBOVESPA p.p.	-7,59 -4,27	-7,59 -4,27	-98,54 -121,01	-98,55 -110,36	-99,05 -100,20	-99,08 -117,23	-99,09 -134,60
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII Var. IFIX p.p.	2,76 2,44	2,76 2,44	-28,31 -32,39	-24,10 -29,45	-23,60 -17,17	-52,38 -71,88	-60,94 -86,94
FI IMOBILIÁRIO THE ONE Var. IFIX p.p.	-0,53 -0,85	-0,53 -0,85	-0,64 -4,71	0,63 -4,72	-13,22 -6,79	0,21 -19,28	-87,74 -113,74
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA Var. IFIX p.p.	1,08 0,76	1,08 0,76	-2,03 -6,10	-1,98 -7,34	-19,81 -13,38	-0,59 -20,09	-5,08 -31,09
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	5,79 9,11	5,79 9,11	9,11 -13,36	20,97 9,15	53,70 52,55	118,69 100,54	138,83 103,32
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	3,98 7,30	3,98 7,30	8,52 -13,96	21,02 9,21	68,09 66,94	139,87 121,73	
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	5,15 0,32	5,15 0,32	11,38 0,68	22,77 0,17	47,08 -0,53	103,21 6,95	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,30 3,59	4,30 3,59	8,24 4,25	27,17 19,81	83,37 72,62		
BALNEÁRIO CAMBORIÚ Var. IPCA + 5,42% p.p.	-0,91 -1,59	-0,91 -1,59	7,63 3,78	4,73 -2,33	3,96 -6,19	21,44 0,42	31,37 -0,97
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON	-1,28	-1,28	12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

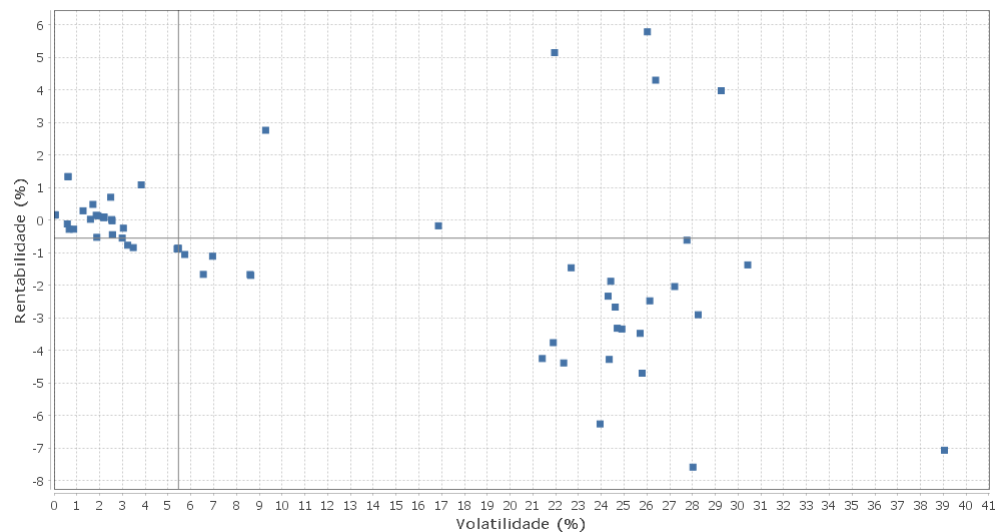
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	506.690,17	0,00	135.456,09113700	3,7406230000
2	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000,00	534,53540600	3,7415670000
3	19/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.593.271,80	0,00	1.227.144,82497700	3,7430560000
4	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.818,80	0,00	14.243,60122300	2,3041083140
5	20/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	500,00	133,56926600	3,7433760000
6	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	266.419,32	71.164,27159900	3,7437230000
7	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	267.113,78029100	3,7437230000
8	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	858.000,00	0,00	229.142,36925100	3,7443970000
9	26/01/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.000.000,00	20.457,02675241	48,8829590000
10	27/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.000,00	2.136,36639500	3,7446760000
11	27/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	49.261,16	13.154,98585100	3,7446760000
12	27/01/2021	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	50.830,39842849	19,6732670000
13	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	30.007,20	8.012,50277200	3,7450470000
14	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.643.155,83	972.793,08682700	3,7450470000
15	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	135.163,68	36.091,31736400	3,7450470000
16	28/01/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	100.000,00	2.045,41655184	48,8897970000
17	28/01/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	100.000,00	0,00	3.411,43611636	29,3131680000

Total

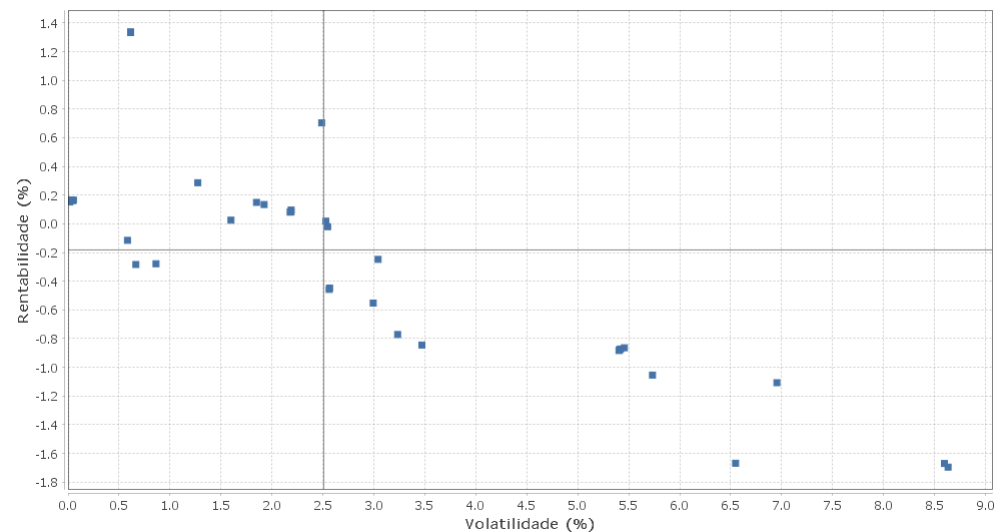
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

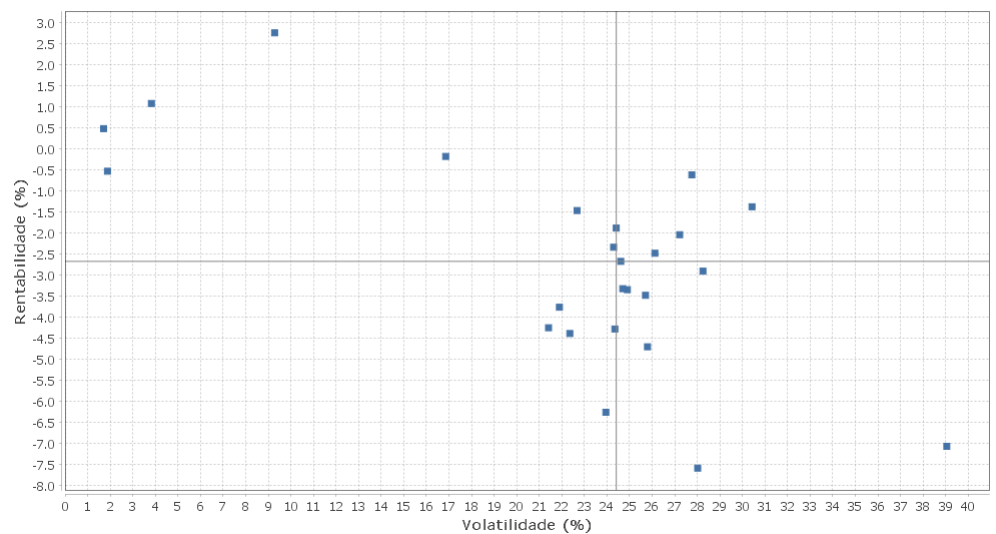
BALNEÁRIO CAMBORIÚ - No Mês



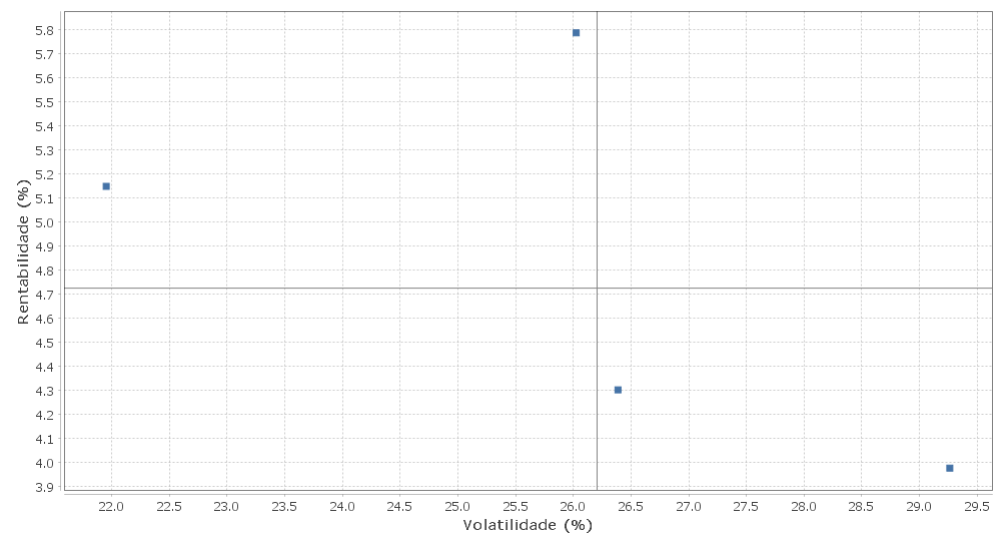
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 21.267.640,35

Value-At-Risk: 3,57%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,11	0,00	0,14	0,15	4.355.463,66	0,73
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,08	0,00	0,60	0,17	1.572.725,52	0,26
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,13	0,00	0,28	0,16	17.121.806,44	2,87
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,09	0,00	0,29	0,17	8.420.255,62	1,41
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,58	0,29	0,00	-0,45	-0,12	25.105.537,66	4,21
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,22	0,00	1,94	1,34	3.003.352,00	0,50
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,22	0,00	1,93	1,33	6.030.196,00	1,01
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,66	0,25	-0,00	-0,65	-0,28	11.182.727,30	1,88
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,86	0,35	0,00	-0,50	-0,28	2.011.768,68	0,34
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,27	1,09	0,00	0,11	0,29	284.631,89	0,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,02	-0,08	0,03	13.040.313,02	2,19
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	1,71	1,19	-0,00	0,19	0,48	1.097.888,36	0,18
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,85	1,09	0,00	-0,00	0,15	888.904,42	0,15
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	1,88	0,09	0,00	-0,36	-0,53	1.117.960,00	0,19
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	1,11	0,00	-0,01	0,13	3.302.675,67	0,55
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,18	1,23	0,00	-0,03	0,08	3.157.694,34	0,53
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,03	-0,03	0,08	25.406.841,01	4,26
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,22	0,07	-0,02	0,10	50.866.250,03	8,53
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	2,49	0,00	-0,00	0,22	0,70	1.947.439,17	0,33
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	2,53	1,41	0,01	-0,05	0,02	6.522.298,31	1,09
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,55	1,37	0,01	-0,07	-0,02	5.108.139,12	0,86
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,56	1,08	0,01	-0,24	-0,46	9.826.349,13	1,65
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,57	1,07	0,01	-0,23	-0,45	4.542.643,73	0,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,03	-0,23	-0,55	20.178.901,64	3,39
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,04	1,21	0,00	-0,13	-0,25	3.504.689,25	0,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,00	-0,28	-0,77	33.994,10	0,01
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,47	1,81	0,01	-0,29	-0,84	5.090.154,82	0,85
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	3,82	0,23	0,00	0,24	1,08	579.096,00	0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,40	2,56	0,01	-0,19	-0,88	2.528.486,30	0,42
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,41	2,56	0,01	-0,19	-0,88	3.470.759,68	0,58
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,20	-0,19	-0,87	69.259.513,01	11,62
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,13	-0,19	-0,86	46.134.299,86	7,74
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,73	2,78	0,04	-0,21	-1,05	13.229.706,99	2,22
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,55	3,18	0,00	-0,28	-1,67	1.202.458,87	0,20
BRADERCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,95	2,85	0,08	-0,18	-1,11	25.521.244,96	4,28
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	8,60	4,25	0,01	-0,21	-1,67	2.906.317,63	0,49
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,63	4,24	0,02	-0,21	-1,70	4.529.932,79	0,76
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	9,28	3,24	-0,00	0,28	2,76	66.927,50	0,01
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,86	8,34	0,10	-0,02	-0,18	11.045.820,51	1,85
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,41	10,55	0,05	-0,21	-4,25	3.100.102,86	0,52
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	9,87	0,04	-0,18	-3,76	2.577.455,75	0,43
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	21,95	9,59	0,00	0,23	5,15	1.002.649,73	0,17
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,35	10,05	0,16	-0,20	-4,39	10.324.026,67	1,73
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,68	9,86	0,15	-0,07	-1,46	9.947.161,32	1,67
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,95	11,62	0,07	-0,27	-6,26	4.169.843,91	0,70
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,30	10,58	0,08	-0,10	-2,34	4.861.131,85	0,82
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	24,35	11,28	0,15	-0,18	-4,28	9.138.324,41	1,53
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,41	11,25	0,07	-0,08	-1,88	3.660.685,36	0,61
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,61	10,39	0,35	-0,11	-2,67	21.201.537,64	3,56
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	24,70	11,62	0,26	-0,14	-3,32	14.212.633,31	2,38
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	24,90	11,75	0,15	-0,14	-3,34	8.129.862,68	1,36
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	25,71	13,35	0,25	-0,14	-3,48	12.194.059,88	2,05
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	25,79	12,66	0,34	-0,19	-4,70	17.433.144,97	2,92
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,03	11,89	0,04	0,22	5,79	8.203.800,76	1,38
BRADERCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	26,13	11,48	0,17	-0,10	-2,48	10.377.163,29	1,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,39	13,23	0,01	0,16	4,30	15.749.815,45	2,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,22	10,75	0,00	-0,08	-2,04	97.825,68	0,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,76	13,04	0,17	-0,03	-0,62	8.594.849,72	1,44
FIP CAIXA CYRELA	Artigo 8º IV, Alínea a	28,02	19,38	0,00	-0,28	-7,59	8.780,02	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	28,25	11,71	0,10	-0,11	-2,91	5.406.098,63	0,91
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	29,26	11,49	0,02	0,13	3,98	4.572.644,28	0,77
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	30,42	10,93	0,05	-0,05	-1,37	3.405.008,09	0,57
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	39,05	19,53	0,07	-0,18	-7,07	2.460.797,19	0,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de janeiro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 5,78% do patrimônio líquido do fundo GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;