



BALNEÁRIO CAMBORIÚ
AGOSTO 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 31.08.2021.

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

RENTA FIXA

64,78%

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 TESOIRO IPCA GERAL FI RF	5,67	-1,10	-2,39	2.490.089,07	0,40	340.081.564,52	0,73
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,62	0,14	1,32	3.156.216,79	0,50	1.537.702.216,54	0,21
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,72	-1,11	-2,33	3.419.987,14	0,54	474.837.001,82	0,72
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,74	-1,13	-2,31	45.458.983,79	7,23	7.360.711.745,51	0,62
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,73	-1,14	-2,35	68.224.635,17	10,84	5.489.990.227,20	1,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,57	-0,38	-0,95	9.777.330,74	1,55	1.140.733.437,19	0,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,13	1,30	25.487.558,38	4,05	11.104.044.700,21	0,23
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,78	-2,24	-5,55	5.834.229,81	0,93	1.109.310.892,98	0,53
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,83	-2,36	-2,29	589.129,04	0,09	1.380.467.864,45	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,56	-0,38	-1,05	4.514.971,73	0,72	365.217.664,31	1,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,99	-0,63	-2,77	33.310,51	0,01	1.494.910.220,59	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,64	0,10	1,30	54.994.496,09	8,74	5.975.243.184,05	0,92
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,31	0,30	2,17	3.200.133,67	0,51	286.564.257,65	1,12
BB	BB	BB PREV RF VII	1,68	0,45	3,32	277.607,59	0,04	240.484.283,62	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,91	-0,45	-1,37	20.012.231,50	3,18	8.803.716.462,71	0,23
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,62	-1,45	-1,51	12.839.829,25	2,04	15.341.053.159,31	0,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	6,80	-1,56	-4,10	1.172.709,04	0,19	1.353.651.560,76	0,09
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,24	0,31	2,29	860.964,52	0,14	570.841.644,52	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,86	-1,45	7,05	6.195.068,00	0,98	208.344.252,43	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	2,91	-1,50	7,05	3.082.850,00	0,49	235.809.058,52	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,95	-0,69	-0,76	271.622.331,83	43,17		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,27	0,42	1,96	10.678.495,83	1,70	9.405.501.513,40	0,11
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,16	-1,00	-2,09	13.090.739,93	2,08	681.209.377,68	1,92
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,19	0,42	1,97	9.302.348,03	1,48	23.481.089.403,56	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27	0,49	2,11	1.417.454,51	0,23	6.449.234.050,26	0,02
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,93	-0,68	-1,01	3.477.743,95	0,55	663.991.044,00	0,52
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,19	0,45	2,17	12.040.910,32	1,91	4.685.526.156,09	0,26
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	8,78	-2,38	-5,56	3.774.977,99	0,60	183.212.046,53	2,06
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	6,52	-1,59	-3,69	24.854.975,46	3,95	779.798.063,25	3,19
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,79	0,08	0,74	5.146.794,09	0,82	1.164.277.281,46	0,44
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	3,31	-0,60	-3,38	4.959.837,58	0,79	338.675.517,23	1,46
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	0,85	0,88	2,90	11.539.219,30	1,83	666.089.814,35	1,73
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	2,77	0,29	1,66	6.463.192,18	1,03	83.988.427,54	7,70
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,65	0,70	2,44	25.748.568,44	4,09	1.777.259.295,94	1,45
SAFRA	SAFRA	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	0,53	0,32	0,98	1.531.131,17	0,24	524.137.635,61	0,29
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,49	-0,15	0,19	134.026.388,78	21,30		

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	0,90	-0,14	-0,35	1.927.039,84	0,31	108.729.058,74	1,77
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,90	-0,14	-0,35	1.927.039,84	0,31		
Renda Fixa			3,44	-0,51	-0,43	407.575.760,45	64,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,08%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,38	-2,50	-0,38	15.691.426,43	2,49	657.892.843,50	2,39
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,38	-2,50	-0,36	15.691.426,43	2,49		

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	BRADESCO F I A SELECTION	20,16	-2,27	-1,70	11.949.201,69	1,90	705.518.161,69	1,69
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	22,87	-4,90	-2,02	18.873.115,42	3,00	564.449.207,50	3,34
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,51	-3,91	-5,20	11.155.427,25	1,77	814.440.020,06	1,37
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	19,85	-2,04	-1,33	9.420.305,32	1,50	1.451.999.747,55	0,65
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,64	-2,76	6,63	22.002.197,04	3,50	2.170.284.029,75	1,01
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,18	-3,13	-1,93	5.757.978,75	0,92	984.203.936,75	0,59
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	32,05	-8,44	-20,59	2.822.305,42	0,45	330.696.267,96	0,85
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,42	-6,82	-7,11	9.363.262,70	1,49	2.748.098.825,53	0,34
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,69	-5,24	-1,89	4.432.193,74	0,70	982.113.788,93	0,45
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,26	-0,57	5,43	3.413.631,70	0,54	1.122.129.483,46	0,30
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	21,53	-4,04	-6,69	4.073.082,33	0,65	418.048.583,42	0,97
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,09	-1,32	-0,83	2.655.940,29	0,42	1.063.389.651,86	0,25
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,54	-5,01	0,30	9.903.349,12	1,57	1.120.309.778,71	0,88
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,49	-1,37	-2,69	795.528,99	0,13	2.126.061.463,94	0,04
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,15	-2,21	6,37	10.738.124,82	1,71	3.356.109.147,78	0,32
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,65	-4,10	4,76	5.832.739,85	0,93	797.338.435,35	0,73
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	22,83	-4,39	-11,65	4.698.463,63	0,75	930.093.742,95	0,51
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,26	-3,74	-0,71	137.886.848,06	21,92		

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	14,76	3,32	22,73	14.170.286,19	2,25	1.823.132.593,52	0,78
Sub-total Artigo 8º III			14,76	3,32	22,73	14.170.286,19	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	35,32	-5,55	-0,62	990.949,84	0,16	17.072.055,09	5,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			35,32	-5,55	-1,47	990.949,84	0,16		

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	9,33	2,04	-1,31	1.109.220,00	0,18	146.345.983,51	0,76
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	18,13	-7,97	-14,55	489.474,00	0,08	731.470.906,95	0,07
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	39,48	0,19	-0,14	65.016,26	0,01	11.158.022,09	0,58
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			10,03	-1,19	-5,57	1.663.710,26	0,26		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,27	-3,05	0,84	170.403.220,78	27,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,14%

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	21,91	3,85	21,16	10.768.049,54	1,71	517.943.932,14	2,08
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	18,91	2,82	15,73	2.368.107,87	0,38	630.642.215,49	0,38
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,38	2,41	11,78	2.351.511,74	0,37	187.854.125,34	1,25
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,42	2,14	12,37	4.750.065,02	0,75	448.226.567,27	1,06
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,18	1,45	4,89	18.790.029,58	2,99	1.611.769.709,71	1,17
Sub-total Artigo 9º A, II			20,04	2,29	10,64	39.027.763,75	6,20		

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	20,09	2,44	17,01	12.180.136,03	1,94	3.230.077.335,87	0,38
Sub-total Artigo 9º A, III			20,09	2,44	17,01	12.180.136,03	1,94		
Investimentos no Exterior			18,79	2,33	12,41	51.207.899,78	8,14		
Total			6,44	-1,00	0,65	629.186.881,01	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos							Pró-Gestão Nível	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	271.622.331,83	43,17	0,00	36,35	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	134.026.388,78	21,30	0,00	15,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.927.039,84	0,31	0,00	0,35	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	407.575.760,45	64,78					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	15.691.426,43	2,49	0,00	3,00	30,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	137.886.848,06	21,92	0,00	22,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	14.170.286,19	2,25	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	990.949,84	0,16	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.663.710,26	0,26	0,00	0,30	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	170.403.220,78	27,08					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	39.027.763,75	6,20	0,00	7,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	12.180.136,03	1,94	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	51.207.899,78	8,14					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	-0,69 -162,71	-0,76 -36,84	-0,68 -62,45	0,72 40,64	3,35 123,93	-1.881.164,26	-2.058.031,45
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,15 -34,69	0,19 9,08	0,27 24,99	1,27 71,67	2,59 95,95	-192.451,08	240.500,53
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,14 -33,07	-0,35 -17,05	-0,48 -44,37	-0,96 -53,95	-1,13 -41,89	-2.706,48	-6.793,94
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,50 -0,02	-0,36 -0,16	-5,90 -0,00	7,77 -0,17	19,20 -0,33	-402.256,21	98.809,84
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,74 -1,26	-0,71 -0,51	-7,58 -1,69	5,49 -2,46	12,79 -6,75	-5.256.539,87	-894.275,08
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,32 5,80	22,73 22,93	8,84 14,73	19,84 11,89	30,12 10,58	455.844,83	2.605.022,22
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,55 -3,07	-1,47 -1,27	-0,31 5,58	-1,06 -9,01	-17,36 -36,90	-58.218,08	-15.929,20
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,19 1,29	-5,57 -5,37	1,78 7,67	-3,73 -11,68	-9,48 -29,02	-20.084,20	-98.103,86
Artigo 9º A, II % do CDI	2,29 540,29	10,64 516,45	5,27 484,44	1,84 104,04	16,28 602,36	797.497,58	2.529.876,46
Artigo 9º A, III % do CDI	2,44 574,20	17,01 825,94	6,70 615,90	6,82 385,40	16,19 598,99	262.703,15	1.425.121,90
BALNEÁRIO CAMBORIÚ (Total)						-6.297.374,62	3.826.197,42

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.102.467,05	0,00	0,00	0,00	20.012.231,50	-90.235,55	-278.748,44
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.532.143,13	0,00	0,00	0,00	4.514.971,73	-17.171,40	-48.105,35
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	54.937.583,56	0,00	0,00	0,00	54.994.496,09	56.912,53	677.260,43
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	45.978.526,13	0,00	0,00	0,00	45.458.983,79	-519.542,34	-1.077.274,54
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.952.151,82	1.000.000,00	0,00	0,00	5.834.229,81	-117.922,01	-273.857,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	881.523,26	0,00	-23.202,77	0,00	860.964,52	2.644,03	19.791,63
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	3.276.268,93	0,00	-85.432,52	0,00	3.200.133,67	9.297,26	69.895,06
BB PREV RF VII	284.220,83	0,00	-7.880,01	0,00	277.607,59	1.266,77	9.210,34
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	2.517.893,58	0,00	0,00	0,00	2.490.089,07	-27.804,51	-60.934,73
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.286.148,00	0,00	0,00	0,00	6.195.068,00	-91.080,00	410.996,08
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	3.129.756,00	0,00	0,00	0,00	3.082.850,00	-46.906,00	204.405,22
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	500.359,40	100.000,00	0,00	0,00	589.129,04	-11.230,36	-10.870,96
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.814.352,94	0,00	0,00	0,00	9.777.330,74	-37.022,20	-94.127,50
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.453.491,18	0,00	0,00	0,00	25.487.558,38	34.067,20	326.850,94
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	69.009.356,85	0,00	0,00	0,00	68.224.635,17	-784.721,68	-1.644.475,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.522,81	0,00	0,00	0,00	33.310,51	-212,30	-947,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	13.028.691,03	0,00	0,00	0,00	12.839.829,25	-188.861,78	-197.186,57
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.458.332,51	0,00	0,00	0,00	3.419.987,14	-38.345,37	-81.459,79
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.151.935,71	0,00	0,00	0,00	3.156.216,79	4.281,08	41.703,39
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.191.286,67	0,00	0,00	0,00	1.172.709,04	-18.577,63	-50.156,15
					271.622.331,83	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6.444.683,53	0,00	0,00	0,00	6.463.192,18	18.508,65	107.340,49
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.257.376,81	2.226.696,62	-2.500.000,00	0,00	12.040.910,32	56.836,89	248.913,98
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	4.989.604,83	0,00	0,00	0,00	4.959.837,58	-29.767,25	-173.672,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	12.127.850,99	21,95	-1.500.000,00	0,00	10.678.495,83	50.622,89	210.276,93
BRADESCO H FI RF NILO	25.256.063,57	0,00	0,00	0,00	24.854.975,46	-401.088,11	-952.196,53
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.142.893,28	0,00	0,00	0,00	5.146.794,09	3.900,81	37.626,41
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3.501.573,82	0,00	0,00	0,00	3.477.743,95	-23.829,87	-35.660,99
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	3.358.565,84	500.000,00	0,00	0,00	3.774.977,99	-83.587,85	-180.721,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.842.922,53	484.559,92	-1.922.047,45	0,00	1.417.454,51	12.019,51	202.212,30
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	11.438.878,50	0,00	0,00	0,00	11.539.219,30	100.340,80	324.726,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	12.894.096,87	4.335.313,96	-7.979.004,94	0,00	9.302.348,03	51.942,14	103.816,22
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	25.569.238,09	0,00	0,00	0,00	25.748.568,44	179.330,35	614.005,45
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	13.223.289,39	0,00	0,00	0,00	13.090.739,93	-132.549,46	-279.918,67
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	1.526.261,75	0,00	0,00	0,00	1.531.131,17	4.869,42	13.751,24
					134.026.388,78	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	1.929.746,32	0,00	0,00	0,00	1.927.039,84	-2.706,48	-6.793,94
					1.927.039,84	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	16.093.682,64	0,00	0,00	0,00	15.691.426,43	-402.256,21	-9.334,41
					15.691.426,43	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.261.165,75	400.000,00	0,00	0,00	4.432.193,74	-228.972,01	-98.578,95
BB AÇÕES DIVIDENDOS	11.609.652,84	0,00	0,00	0,00	11.155.427,25	-454.225,59	-642.345,24
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	19.846.339,96	0,00	0,00	0,00	18.873.115,42	-973.224,54	-420.678,08
BRADESCO F I A SELECTION	11.203.224,39	1.000.000,00	0,00	0,00	11.949.201,69	-254.022,70	-191.919,78
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22.625.815,47	0,00	0,00	0,00	22.002.197,04	-623.618,43	1.518.458,26
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	9.616.612,81	0,00	0,00	0,00	9.420.305,32	-196.307,49	-126.810,77
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	9.108.538,71	900.000,00	0,00	0,00	9.363.262,70	-645.276,01	-684.822,76
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	2.766.624,68	300.000,00	0,00	0,00	2.822.305,42	-244.319,26	-625.737,47
FIA CAIXA CONSUMO	3.845.023,44	400.000,00	0,00	0,00	4.073.082,33	-171.941,11	-279.383,46
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	10.426.079,67	0,00	0,00	0,00	9.903.349,12	-522.730,55	269.769,56
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	2.691.494,66	0,00	0,00	0,00	2.655.940,29	-35.554,37	-22.287,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	10.980.262,99	0,00	0,00	0,00	10.738.124,82	-242.138,17	643.173,39
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.439.011,10	500.000,00	0,00	0,00	5.757.978,75	-181.032,35	-119.443,96
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6.082.079,65	0,00	0,00	0,00	5.832.739,85	-249.339,80	264.828,85
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	704.421,96	100.000,00	0,00	0,00	795.528,99	-8.892,97	-4.471,01
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	4.503.982,31	400.000,00	0,00	0,00	4.698.463,63	-205.518,68	-549.896,46
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	3.433.057,54	0,00	0,00	0,00	3.413.631,70	-19.425,84	175.870,21
					137.886.848,06	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13.714.441,36	0,00	0,00	0,00	14.170.286,19	455.844,83	2.605.022,22
					14.170.286,19	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	1.049.167,92	0,00	0,00	0,00	990.949,84	-58.218,08	-6.428,08
					990.949,84	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	1.087.028,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.109.220,00	22.192,00	-14.668,00
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	531.872,10	0,00	0,00	0,00	0,00	489.474,00	-42.398,10	-83.344,11
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	64.894,36	0,00	0,00	0,00	0,00	65.016,26	121,90	-91,75
						1.663.710,26	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.404.228,72	1.000.000,00	0,00	0,00	10.768.049,54	363.820,82	1.370.306,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1.322.729,85	1.000.000,00	0,00	0,00	2.368.107,87	45.378,02	118.107,87
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.319.440,18	1.000.000,00	0,00	0,00	2.351.511,74	32.071,56	101.511,74
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.161.640,32	500.000,00	0,00	0,00	4.750.065,02	88.424,70	250.065,02
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18.522.227,10	0,00	0,00	0,00	18.790.029,58	267.802,48	689.884,97
					39.027.763,75	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	10.917.432,88	1.000.000,00	0,00	0,00	12.180.136,03	262.703,15	1.425.121,90
					12.180.136,03	0,00	0,00

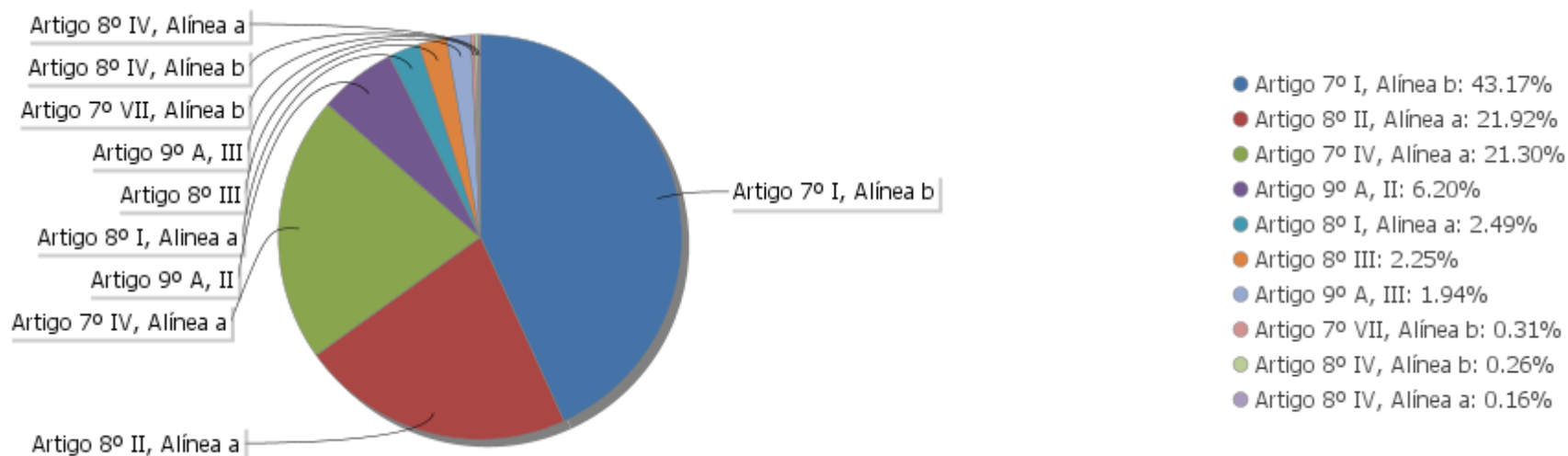
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

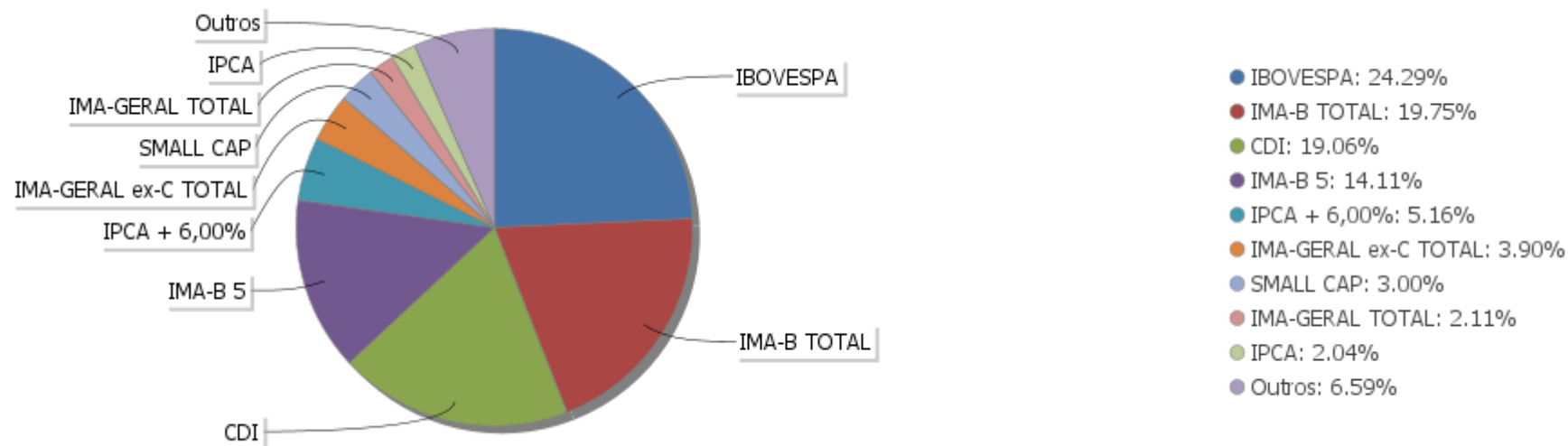
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	575.420.845,46	91,45	575.420.845,46	91,45
de 31 a 365 dias	37.509.029,68	5,96	612.929.875,14	97,42
acima de 365 dias	16.257.005,87	2,58	629.186.881,01	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

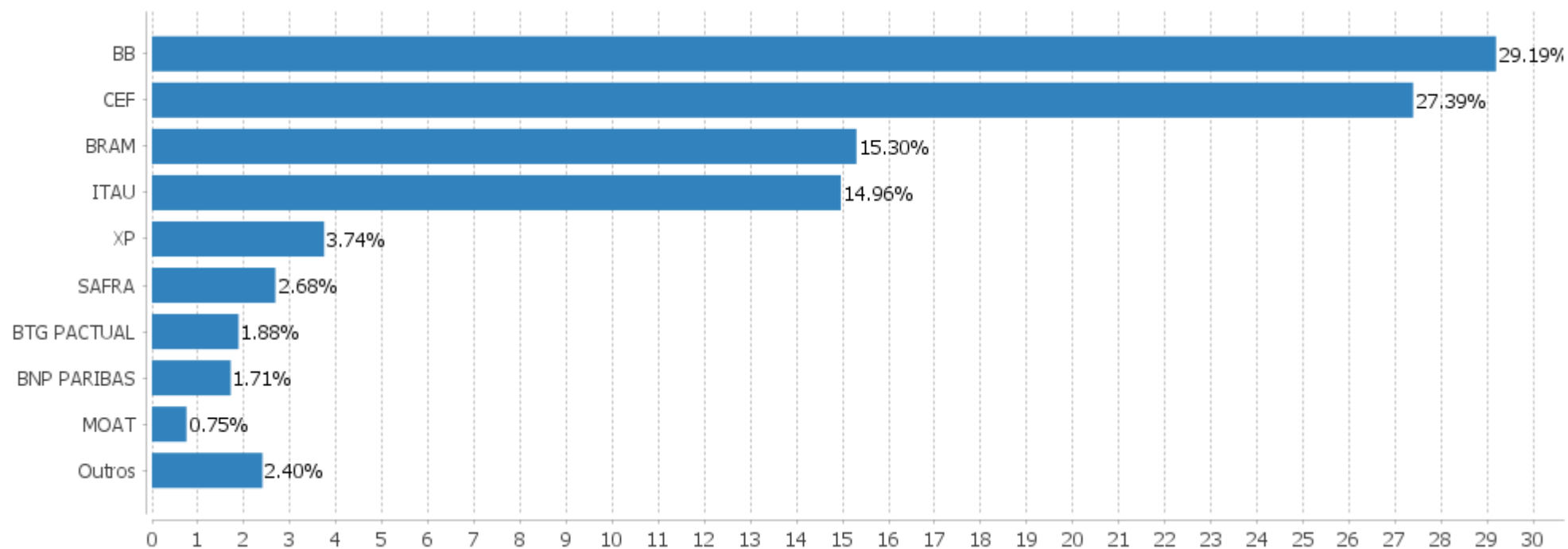


Alocação Por Estratégia



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	-1,04	0,97	1,36	1,87	0,33	-0,89	-1,00					0,65
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34					9,43
p.p. indexador	-1,59	-2,28	-0,45	0,63	0,60	-0,64	-2,32	-2,33					-8,79
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

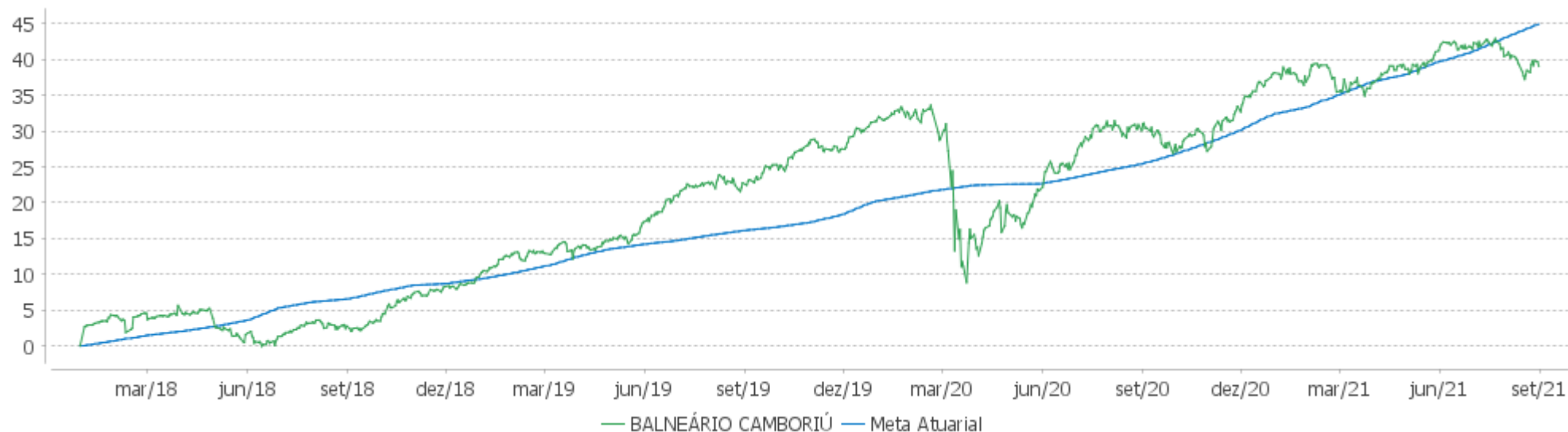
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

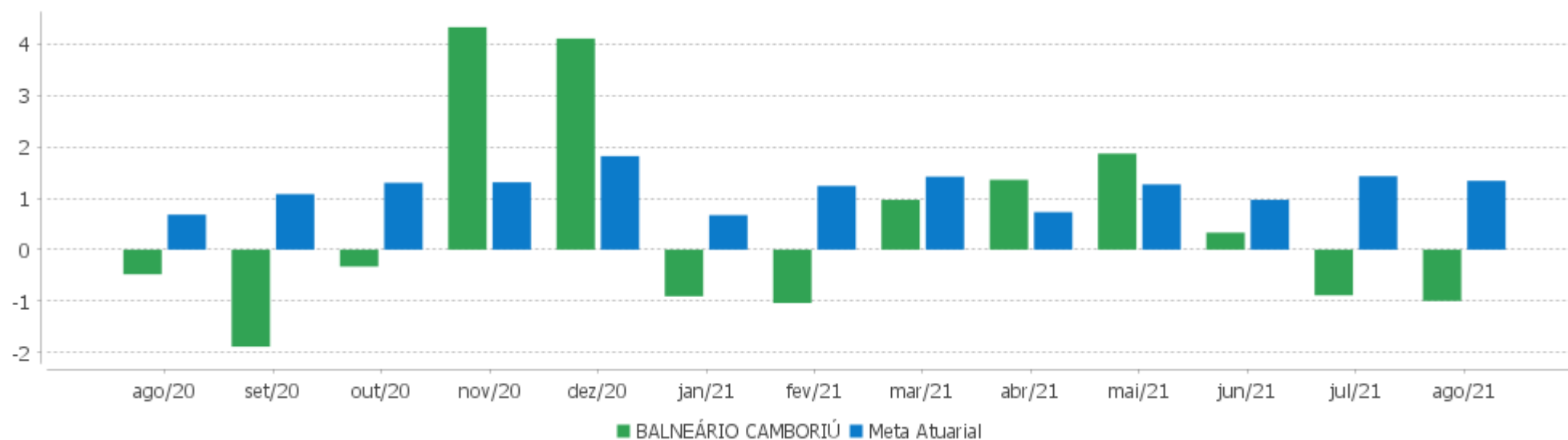
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	50,00	03 meses	-1,55	3,78	-5,33	5,27
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	50,00	06 meses	2,64	7,37	-4,73	5,66
			12 meses	6,90	15,76	-8,86	6,44
			24 meses	13,26	25,60	-12,34	11,23
			36 meses	35,27	37,61	-2,34	9,54
			Desde 29/12/2017	39,05	47,17	-8,12	9,05
	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
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-0,14 -33,07	-0,35 -17,05	-0,48 -44,37	-0,96 -53,95	-1,13 -41,89	30,94 462,99	28,60 213,73
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,08	0,74 -0,73	-0,08 -0,13	1,56 -0,41	3,79 -0,98	13,37 -1,09	29,60 -1,36
BRADERCO H FI RF NILO % do CDI	-1,59 -374,43	-3,69 -179,11	-1,84 -168,63	-0,86 -48,55	1,88 69,65	9,25 138,38	41,07 306,92
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,42 99,00	1,96 95,03	1,11 101,80	1,72 96,86	2,37 87,64	6,12 91,54	12,59 94,08
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,49 115,73	2,11 102,55	1,25 115,15	1,87 105,52	2,76 102,22	6,22 93,00	12,72 95,05
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,29 -1,10	1,66 -8,17	0,01 -3,92	2,24 -5,43	4,28 -11,95	15,68 -10,54	37,13 -1,15
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,38 -0,16	-5,56 -0,12	-2,45 -0,29	-1,78 -0,26	1,53 -0,27	5,42 -1,18	44,97 -2,35
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC % do CDI	0,88 206,82	2,90 140,56	1,96 180,29	3,31 187,17	3,66 135,51	13,20 197,49	26,07 194,81
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,00 -236,34	-2,09 -101,63	-0,79 -72,33	0,59 33,20	3,13 115,69	11,60 173,58	43,67 326,34
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,45 105,42	2,17 105,51	1,17 107,82	1,91 107,74	2,78 102,89	6,29 94,15	12,84 95,94
BRADERCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,60 -140,66	-3,38 -164,23	-1,22 -111,82	-1,34 -75,49	-2,29 -84,91	8,04 120,28	25,04 187,12
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF % do CDI	0,32 75,22	0,98 47,80	0,81 73,97	1,32 74,78	1,88 69,58	6,61 98,93	
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,70 165,36	2,44 118,58	1,65 151,79	2,72 153,39	3,14 116,34		
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,42 98,45	1,97 95,83	1,12 102,67	1,71 96,75	2,45 90,62	6,24 93,37	12,75 95,27
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,68 -0,27	-1,01 -0,64	-0,63 -0,47	-0,03 -0,60	1,46 -0,41	8,35 -0,16	25,70 0,02
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,30 1,39	2,17 4,34	0,79 1,84	2,54 2,35	5,35 2,09	15,88 5,76	36,97 -3,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-1,14	-2,35	-1,14	0,05	3,01	9,40	39,26

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.	-0,05	-0,18	-0,09	-0,14	-0,26	-0,73	-1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	1,30	-0,00	1,85	4,50	13,83	30,03
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,16	-0,05	-0,12	-0,27	-0,63	-0,94
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,14	1,32	-0,00	1,86	4,51	13,99	30,02
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,15	-0,05	-0,11	-0,25	-0,46	-0,95
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,10	1,30	-0,06	1,82	4,51	13,87	30,03
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,05	-0,17	-0,11	-0,14	-0,25	-0,58	-0,93
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	-1,10	-2,39	-1,10	-0,01	2,98	9,54	39,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,22	-0,06	-0,20	-0,29	-0,58	-1,32
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,31	2,29	0,86	2,60	5,47	13,77	30,64
Var. INPC + 6,00% p.p.	-1,08	-7,82	-3,21	-5,37	-11,55	-13,92	-9,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,63	-2,77	-0,92	-0,87	-1,50	6,86	24,47
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,04	-0,14	-0,06	-0,20	-0,25	-0,48	-0,77
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,38	-0,95	-0,22	0,33	1,25	7,26	23,77
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,03	-0,58	-0,06	-0,24	-0,62	-1,24	-1,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-2,36	-5,68	-2,36	-1,74	1,53	5,86	45,50
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,14	-0,24	-0,19	-0,21	-0,27	-0,74	-1,82
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	-1,45	7,05	1,02	4,82	12,68	22,38	34,05
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,83	-2,78	-2,91	-2,86	-3,56	-3,83	-4,22
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	-1,56	-4,10	-1,70	-0,63	1,00	9,65	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47	-1,93	-0,66	-0,82	-2,26	-0,48	
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	-1,11	-2,33	-1,10	0,07	2,98	9,55	39,09
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,16	-0,06	-0,12	-0,29	-0,57	-1,34
BB PREV RF VII	0,45	3,32	1,47	3,04	6,51	12,96	26,54
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,54	5,49	2,51	2,85	3,25	2,84	-13,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,45	-1,37	-0,59	0,09	0,99	7,10	24,38
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,11	-0,59	-0,47	-0,40	-0,31	-0,44	0,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	-1,45	-1,51	-2,22	-1,04	-0,01	9,20	27,34
Var. IPCA p.p.	-2,32	-7,19	-4,60	-5,55	-9,69	-3,15	11,13
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	-1,50	7,05	0,98	4,80	12,69	22,48	34,26
Var. INPC + 6,00% p.p.	-2,89	-3,06	-3,09	-3,16	-4,33	-5,20	-5,44
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,13	-2,31	-1,14	0,07	3,03	9,60	39,38
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,14	-0,09	-0,12	-0,24	-0,52	-1,06
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,38	-1,05	-0,24	0,23	0,96	6,86	23,26
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,04	-0,27	-0,12	-0,26	-0,35	-0,69	-1,06
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-2,24	-5,55	-2,26	-1,65	1,49	6,09	46,05

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.	-0,02	-0,11	-0,09	-0,12	-0,31	-0,50	-1,27
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3,32	22,73	8,84	19,84	30,12	53,55	59,83
Var. IBOVESPA p.p.	5,80	22,93	14,73	11,89	10,58	36,10	4,92
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	0,19	-0,14	-5,27	-2,45	-26,35	-55,80	-62,04
Var. IFIX p.p.	2,82	4,05	-2,91	2,29	-25,19	-59,30	-90,58
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	2,04	-1,31	3,51	-0,51	-2,74	-2,70	13,97
Var. IFIX p.p.	4,67	2,89	5,88	4,22	-1,58	-6,21	-14,56
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	-7,97	-14,55	-0,98	-10,44	-19,66	-17,91	-4,72
Var. IFIX p.p.	-5,34	-10,36	1,38	-5,71	-18,50	-21,41	-33,25
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	-4,90	-2,02	-9,83	5,16	13,58	12,53	63,80
Var. SMALL CAP p.p.	-1,08	-2,97	-1,61	-1,34	-3,40	-11,49	-23,56
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-0,57	5,43	-3,08	13,79	19,92	25,39	83,45
Var. IBOVESPA p.p.	1,91	5,63	2,81	5,84	0,39	7,94	28,54
BRADESCO F I A SELECTION	-2,27	-1,70	-5,08	4,18	15,34	3,86	42,46
Var. IBOVESPA p.p.	0,21	-1,50	0,81	-3,77	-4,20	-13,59	-12,45
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-4,10	4,76	-3,34	12,74	13,56	-5,94	38,80
Var. IBOVESPA p.p.	-1,62	4,95	2,55	4,79	-5,98	-23,39	-16,11
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-5,24	-1,89	-9,55	0,97	17,52	20,24	56,43
Var. IBOVESPA p.p.	-2,76	-1,70	-3,66	-6,98	-2,01	2,80	1,52
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-8,44	-20,59	-17,01	-4,90	-13,74	-25,62	29,44
% do CDI	-1.990,53	-999,57	-1.562,44	-276,54	-508,31	-383,28	219,99
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-2,21	6,37	-5,41	7,44	21,25	18,06	72,78
Var. IBOVESPA p.p.	0,27	6,57	0,48	-0,51	1,72	0,61	17,87
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,32	-0,83	-6,13	7,69	17,88	16,54	75,29
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,82	-0,64	-1,80	-3,23	-1,51	1,49	2,42
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	-2,04	-1,33	-5,98	7,26	17,87	4,09	35,59
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,54	-1,13	-1,66	-3,66	-1,53	-10,96	-37,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-6,82	-7,11	-9,94	-4,11	1,31	11,58	71,44
Var. IBOVESPA p.p.	-4,34	-6,91	-4,05	-12,06	-18,23	-5,87	16,53
FIA CAIXA CONSUMO	-4,04	-6,69	-8,67	-0,03	-1,04	4,48	55,46
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,14	-0,80	-0,33	-0,68	-1,45	-1,72	-5,34
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-4,39	-11,65	-11,00	0,22	-0,59		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,91	-11,45	-5,11	-7,73	-20,13		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-5,01	0,30	-9,02	6,03	14,67	19,17	73,23
Var. IBOVESPA p.p.	-2,53	0,50	-3,13	-1,91	-4,86	1,72	18,32
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-1,37	-2,56	-3,44	3,27	11,39	15,54	65,72

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.	1,11	-2,36	2,45	-4,68	-8,14	-1,91	10,81
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-3,13	-1,93	-7,00	4,44	14,19	15,31	58,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,65	-1,73	-1,11	-3,51	-5,34	-2,14	4,06
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-3,91	-5,20	-9,88	4,08	8,91	-2,85	33,27
Var. IBOVESPA p.p.	-1,43	-5,00	-3,99	-3,87	-10,62	-20,30	-21,64
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,76	6,63	-5,25	10,42	16,33	23,54	84,21
Var. IBOVESPA p.p.	-0,28	6,83	0,64	2,47	-3,20	6,09	29,30
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	-5,55	-0,62	-0,31	-1,06	28,17	45,97	198,99
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-6,93	-10,45	-4,24	-8,74	11,93	19,75	160,72
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-2,50	-0,38	-5,90	7,77	19,17	16,93	53,35
Var. IBOVESPA p.p.	-0,02	-0,18	-0,01	-0,18	-0,37	-0,52	-1,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,44	17,01	6,70	6,82	16,19	96,21	100,73
Var. IBOVESPA p.p.	4,91	17,21	12,59	-1,12	-3,35	78,76	45,82
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,85	21,16	13,37	12,58	23,78	130,37	
Var. IBOVESPA p.p.	6,33	21,36	19,26	4,63	4,25	112,92	
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,14	17,85	4,55	7,00	22,74	88,65	
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,65	4,33	2,13	2,09	3,59	8,32	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	2,82	17,17	10,60	14,70	27,85		
Var. MSCI ACWI p.p.	0,03	3,65	8,18	9,79	8,70		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,45	4,89	1,45	-3,69	10,96		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,06	-4,94	-2,48	-11,36	-5,27		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,41	11,05	8,44	8,95	29,31		
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,38	-2,47	6,02	4,04	10,16		
BALNEÁRIO CAMBORIÚ	-1,00	0,65	-1,55	2,64	6,90	13,26	35,27
Var. IPCA + 5,42% p.p.	-2,33	-8,79	-5,33	-4,73	-8,70	-11,58	-0,76
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,34	-0,78	-0,12	0,49	1,31	7,55	24,32	31,67	51,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,14	35,76

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,15	35,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42
MSCI World	2,78	15,58	3,77	7,14	20,26	82,56	79,59	161,97	189,98

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

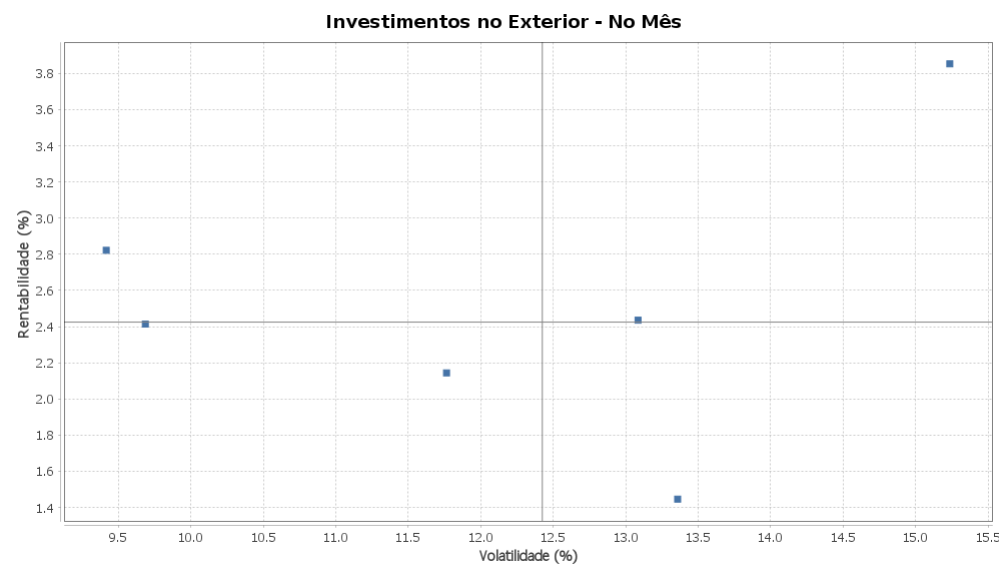
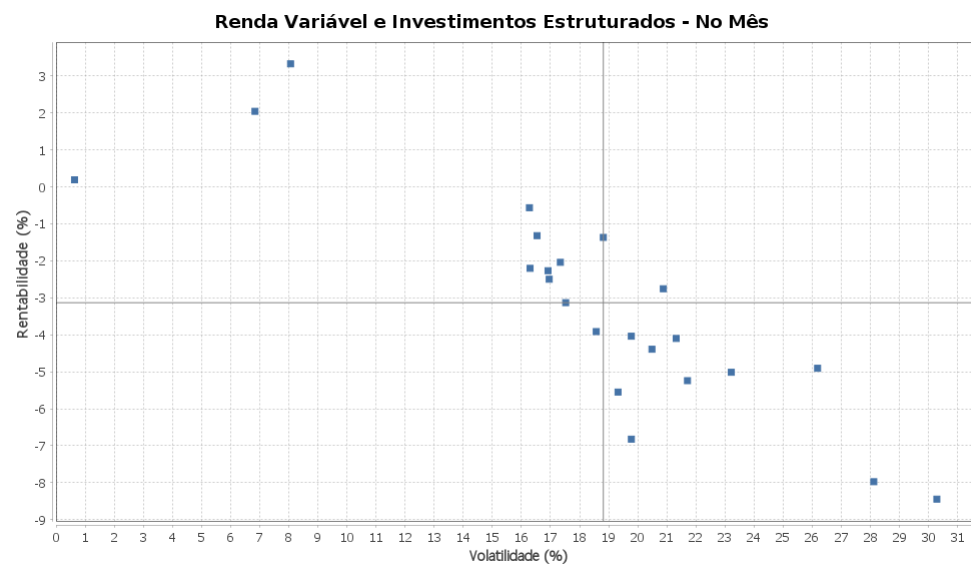
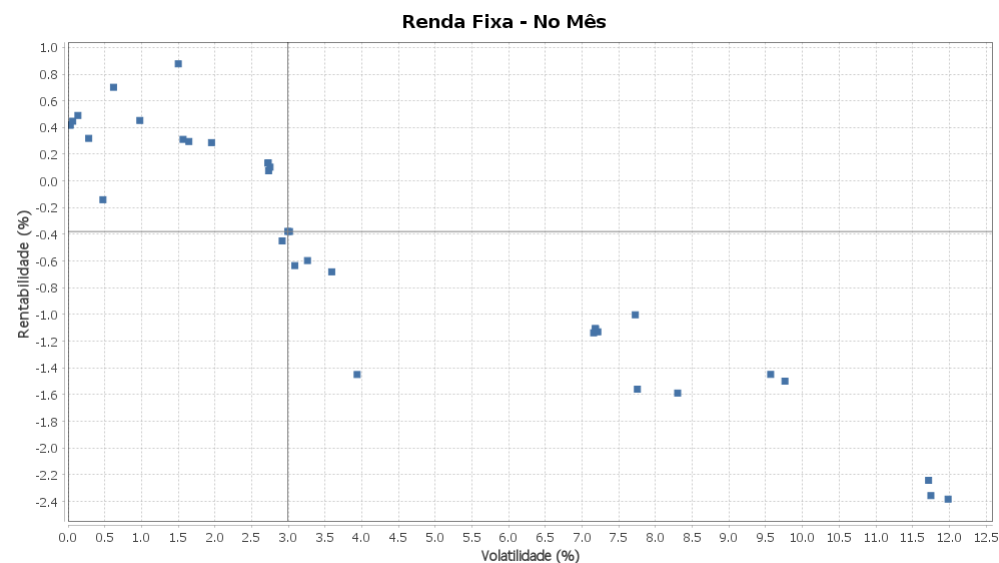
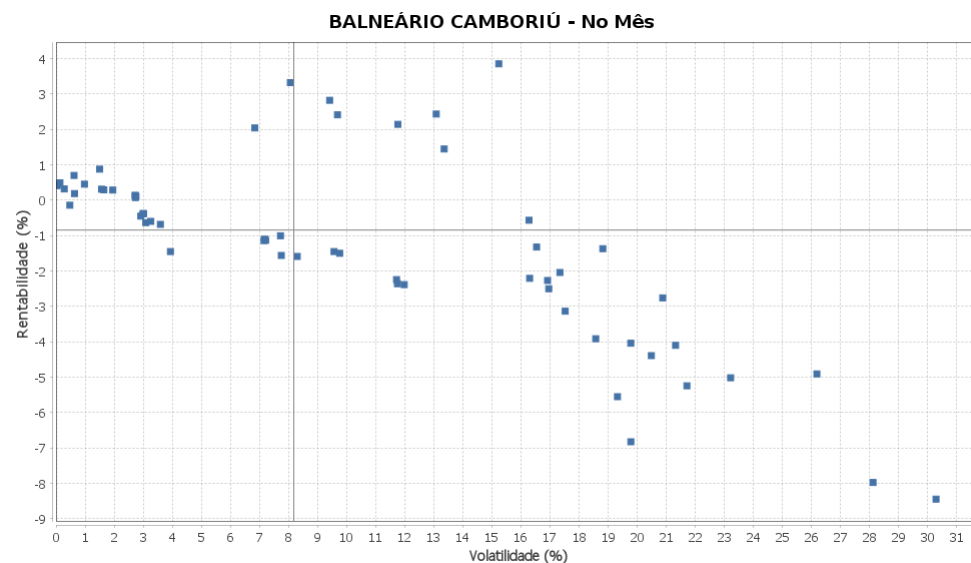
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
313	02/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	137.612,98	2.775,75890000	49,5767050000
323	02/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	321,95	84,71556700	3,8003640000
297	03/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	351,10	7,08083000	49,5846040000
314	03/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	17.684,89	356,66092000	49,5846040000
325	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	120.798,91	31.776,60159900	3,8015050000
340	04/08/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	21,95	0,00	1,77998340	12,3315752000
298	05/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	5.659,91	114,11153000	49,5998120000
315	05/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.089.057,61	21.956,88988000	49,5998120000
308	06/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	28.482,69	0,00	574,13762000	49,6095170000
299	10/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	6.389,31	128,74122000	49,6290950000
300	10/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	328,40	6,61709000	49,6290950000
309	10/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	58.351,46	0,00	1.175,75104000	49,6290950000
327	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	201.988,27	0,00	53.091,79631500	3,8045100000
301	11/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	12.796,03	257,78408000	49,6385590000
333	11/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20,90	0,00	8,91278400	2,3449461340
310	13/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	12.576,74	0,00	253,26638000	49,6581520000
332	16/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	43.412,64	0,00	18.501,26620200	2,3464685890
334	16/08/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	23.202,77	9.860,86634800	2,3530153620
335	16/08/2021	BB PREV RF VII	0,00	7.880,01	4.157,84287200	1,8952159190
337	16/08/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	85.432,52	35.442,22552600	2,4104727830
339	16/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.183.263,08	0,00	930.446,32697600	2,3464685890
311	17/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	4.639,56	0,00	93,39333000	49,6776420000
324	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	926,59	243,05466300	3,8122690000
328	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	282.571,65	0,00	74.121,64514000	3,8122690000
305	23/08/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	100.000,00	0,00	3.531,62851000	28,3155490000
326	23/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.800.000,00	472.077,52973200	3,8129330000
338	23/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.500.000,00	1.064.303,56264400	2,3489538960
347	24/08/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	459,20405720	1.088,8405538000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
312	24/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	4.231.263,51	0,00	85.091,71918000	49,7259140000
321	24/08/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	100.000,00	0,00	37.916,07201600	2,6374040000
329	24/08/2021	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	900.000,00	0,00	191.139,66964300	4,7085987000
330	24/08/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	459,20405720	1.088,8405538000
306	25/08/2021	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	500.000,00	0,00	22.580,22415000	22,1432700000
307	25/08/2021	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	500.000,00	0,00	153.521,82129000	3,2568660000
319	25/08/2021	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	300.000,00	0,00	211.055,21274700	1,4214290000
320	25/08/2021	FIA CAIXA CONSUMO	400.000,00	0,00	193.761,93149600	2,0643890000
336	25/08/2021	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.000.000,00	0,00	294.492,00546900	3,3956779180
322	26/08/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	162.294,42773442	6,1616410000
296	27/08/2021	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	400.000,00	0,00	105.789,13311280	3,7811067000
302	27/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	3.734,05	75,04718000	49,7560350000
316	27/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.559,93	31,35158000	49,7560350000
317	27/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	2.800.000,00	56.274,58057000	49,7560350000
293	30/08/2021	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1.000.000,00	0,00	6.048,10117889	165,3411493000
294	30/08/2021	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	6.572,81987007	152,1417017000
295	30/08/2021	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	400.000,00	0,00	121.163,06852741	3,3013360000
303	30/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	35.310,88	709,54058000	49,7658360000
318	30/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	3.786.379,88	76.083,91995000	49,7658360000
341	30/08/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	433.905,76	35.062,82589280	12,3750939000
342	30/08/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	1.066.094,24	86.148,37581150	12,3750939000
344	30/08/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	500.000,00	0,00	151.827,11021840	3,2932195000
304	31/08/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	82.139,97	1.650,19532000	49,7759080000
343	31/08/2021	BRADESCO F I A SELECTION	1.000.000,00	0,00	1.024,04904370	976,5157305000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 15.968.984,20

Value-At-Risk: 2,54%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,04	-0,00	-0,24	0,42	9.302.348,03	1,48
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,04	-0,00	-0,15	0,42	10.678.495,83	1,70
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,03	-0,00	0,36	0,45	12.040.910,32	1,91
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,05	0,00	0,50	0,49	1.417.454,51	0,23
SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,28	0,24	0,00	-0,37	0,32	1.531.131,17	0,24
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,48	0,04	0,00	-1,19	-0,14	1.927.039,84	0,31
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,62	0,30	0,00	0,45	0,70	25.748.568,44	4,09
RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,64	0,15	-0,00	-0,37	0,19	65.016,26	0,01
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,98	0,61	0,00	0,03	0,45	277.607,59	0,04
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	Artigo 7º IV, Alínea a	1,50	0,53	-0,00	0,30	0,88	11.539.219,30	1,83
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,57	0,88	0,00	-0,07	0,31	860.964,52	0,14
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,65	0,94	0,00	-0,08	0,30	3.200.133,67	0,51
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	Artigo 7º IV, Alínea a	1,95	1,08	0,01	-0,07	0,29	6.463.192,18	1,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,72	1,25	0,03	-0,11	0,13	25.487.558,38	4,05
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,73	1,25	0,00	-0,11	0,14	3.156.216,79	0,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,73	1,28	0,01	-0,13	0,08	5.146.794,09	0,82
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,75	1,27	0,07	-0,12	0,10	54.994.496,09	8,74
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,92	1,21	0,03	-0,30	-0,45	20.012.231,50	3,18
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,18	0,01	-0,27	-0,38	9.777.330,74	1,55
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,02	1,17	0,01	-0,27	-0,38	4.514.971,73	0,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,09	1,23	0,00	-0,34	-0,63	33.310,51	0,01
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,26	1,36	0,01	-0,31	-0,60	4.959.837,58	0,79
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,59	1,43	0,01	-0,31	-0,68	3.477.743,95	0,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,48	0,02	-0,48	-1,45	12.839.829,25	2,04
FI IMOBILIÁRIO THE ONE	Artigo 8º IV, Alínea b	6,84	0,15	-0,00	0,24	2,04	1.109.220,00	0,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,16	3,02	0,25	-0,22	-1,14	68.224.635,17	10,84
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	7,18	3,02	0,01	-0,21	-1,10	2.490.089,07	0,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,18	3,01	0,01	-0,21	-1,11	3.419.987,14	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,21	3,03	0,17	-0,22	-1,13	45.458.983,79	7,23
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	7,72	3,08	0,05	-0,18	-1,00	13.090.739,93	2,08
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	7,75	3,21	0,00	-0,26	-1,56	1.172.709,04	0,19
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	8,06	5,48	0,07	0,36	3,32	14.170.286,19	2,25
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	8,30	3,45	0,10	-0,24	-1,59	24.854.975,46	3,95
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	9,42	5,97	0,01	0,25	2,82	2.368.107,87	0,38
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	9,57	0,18	0,00	-0,20	-1,45	6.195.068,00	0,98
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	9,69	6,85	0,01	0,21	2,41	2.351.511,74	0,37
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	9,76	0,19	0,00	-0,20	-1,50	3.082.850,00	0,49
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,72	4,21	0,03	-0,23	-2,24	5.834.229,81	0,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,75	4,18	0,00	-0,24	-2,36	589.129,04	0,09
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	11,76	6,44	-0,01	0,15	2,14	4.750.065,02	0,75
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	11,98	4,17	0,02	-0,23	-2,38	3.774.977,99	0,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,08	7,38	-0,01	0,15	2,44	12.180.136,03	1,94
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	13,36	7,95	-0,01	0,08	1,45	18.790.029,58	2,99
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	15,24	7,62	-0,02	0,23	3,85	10.768.049,54	1,71
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,28	6,32	0,03	-0,06	-0,57	3.413.631,70	0,54
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	16,30	7,51	0,11	-0,16	-2,21	10.738.124,82	1,71
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	16,54	6,70	0,02	-0,11	-1,32	2.655.940,29	0,42
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	16,91	6,78	0,11	-0,16	-2,27	11.949.201,69	1,90
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	16,96	7,06	0,15	-0,17	-2,50	15.691.426,43	2,49
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	17,34	6,60	0,08	-0,14	-2,04	9.420.305,32	1,50
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	17,52	6,44	0,05	-0,20	-3,13	5.757.978,75	0,92
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	6,79	0,10	-0,23	-3,91	11.155.427,25	1,77
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	18,82	6,83	0,01	-0,10	-1,37	795.528,99	0,13
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	19,32	0,18	0,00	-0,31	-5,55	990.949,84	0,16
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	19,78	9,23	0,05	-0,23	-4,04	4.073.082,33	0,65
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,78	8,41	0,10	-0,37	-6,82	9.363.262,70	1,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,49	9,31	0,06	-0,23	-4,39	4.698.463,63	0,75
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,88	7,30	0,22	-0,15	-2,76	22.002.197,04	3,50
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	21,32	8,06	0,07	-0,21	-4,10	5.832.739,85	0,93
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,71	7,44	0,05	-0,26	-5,24	4.432.193,74	0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	23,22	9,11	0,13	-0,23	-5,01	9.903.349,12	1,57
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	26,18	9,94	0,26	-0,20	-4,90	18.873.115,42	3,00
FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Artigo 8º IV, Alínea b	28,12	0,55	-0,00	-0,30	-7,97	489.474,00	0,08
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	30,28	11,40	0,04	-0,29	-8,44	2.822.305,42	0,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 5,80% do Patrimônio Líquido do fundo GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;