



**LDB**  
EMPRESAS

**GUARUJÁ**  
SETEMBRO 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 18.01.2021.

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

62,00%

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
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	5,22	-0,22	4,22	8.713.271,43	1,25	617.958.021,35	1,41
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,59	-2,12	-0,22	1.474.343,47	0,21	1.126.582.665,78	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,72	-1,56	-0,93	28.424.903,18	4,07	5.533.318.681,28	0,51
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	19,81	-2,62	-4,85	15.514.859,15	2,22	952.869.437,77	1,63
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,49	-0,61	1,92	11.051.744,23	1,58	1.241.251.655,53	0,89
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	4,29	19.827.431,90	2,84	17.747.142.317,32	0,11
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,77	-1,54	-1,17	22.978.004,95	3,29	1.112.978.638,16	2,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,08	0,04	4,84	15.110.392,35	2,16	9.208.011.978,57	0,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	-0,61	4,41	32.358.893,42	4,63	11.234.342.142,99	0,29
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,16	-0,81	-0,85	29.062.370,38	4,16	717.075.038,12	4,05
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,10	-0,30	5,57	3.791.428,95	0,54	350.162.776,21	1,08
BB	BB	BB PREV IPCA II	1,17	0,02	1,03	0,00	0,00		
BB	BB	BB PREV RF VII	2,35	0,19	2,64	3.400.161,84	0,49	238.949.489,36	1,42
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,20	-0,26	3,97	5.700.028,30	0,82	422.068.298,70	1,35
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,95	0,19	5,23	3.795.367,41	0,54	197.875.837,91	1,92
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	20.855.985,82	2,99	13.535.810.678,86	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,72	-0,77	4,64	7.853.872,31	1,12	1.408.015.961,73	0,56
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,81	-1,92	1,00	1.799.487,75	0,26	65.920.440,24	2,73
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	13,81	-1,92	1,01	4.362.430,45	0,62	354.253.837,74	1,23
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,40	0,19	4,71	1.357.591,03	0,19	457.006.791,34	0,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,15</b>	<b>-0,88</b>	<b>2,78</b>	<b>237.432.568,32</b>	<b>34,00</b>		

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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,52	-1,67	0,38	23.022.016,01	3,30	634.471.413,86	3,63
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,94	-0,51	2,72	34.739.031,06	4,97	782.744.149,23	4,44
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,29	-1,60	-0,80	41.135.663,53	5,89	1.950.918.734,76	2,11
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	-0,00	1,42	1.803.072,08	0,26	1.878.414.583,86	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,64	447.358,83	0,06	480.823.075,37	0,09
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,38	-0,19	4,48	5.580.338,98	0,80	788.410.647,13	0,71
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,65	-0,23	2,47	64.426.915,82	9,22	4.773.930.449,92	1,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	6,84	-0,88	-0,77	7.327.910,93	1,05	2.073.034.805,37	0,35
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>7,41</b>	<b>-0,77</b>	<b>0,71</b>	<b>178.482.307,24</b>	<b>25,55</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,48	-0,08	4,11	4.371.434,97	0,63	604.107.677,88	0,72
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CRED PRIV	6,02	-0,20	3,58	12.769.962,59	1,83	769.000.249,14	1,66
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>5,59</b>	<b>-0,17</b>	<b>3,72</b>	<b>17.141.397,56</b>	<b>2,45</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,16</b>	<b>-0,80</b>	<b>1,92</b>	<b>433.056.273,12</b>	<b>62,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

33,15%

## 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	44,29	-4,81	-18,40	2.626.322,38	0,38	339.715.925,19	0,77
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYC IBOVESPA	45,67	-5,32	-17,55	7.225.968,45	1,03	143.616.997,32	5,03
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>45,26</b>	<b>-5,19</b>	<b>-17,82</b>	<b>9.852.290,83</b>	<b>1,41</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	42,98	-4,27	-20,98	1.264.532,88	0,18	543.611.577,48	0,23
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	39,27	-5,41	-24,63	19.752.907,08	2,83	1.403.610.816,89	1,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	40,53	-4,93	-16,09	7.004.976,48	1,00	91.702.322,28	7,64
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	40,62	-4,50	-2,77	9.175.701,76	1,31	938.576.363,18	0,98
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,87	-5,97	-17,19	20.695.676,76	2,96	1.179.854.959,21	1,75
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	47,89	-4,10	-14,43	5.870.443,75	0,84	151.476.022,96	3,88
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,49	-2,97	-4,02	45.377.147,23	6,50	2.439.151.651,37	1,86
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,35	-4,45	-15,69	5.665.553,65	0,81	844.202.491,55	0,67
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,30	-5,72	-13,09	8.915.727,93	1,28	839.942.986,14	1,06
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,48	-4,96	-20,69	21.600.674,98	3,09	3.159.975.144,49	0,68
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	51,80	-8,03	-33,17	8.195.319,80	1,17	1.558.252.031,74	0,53
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	50,29	-5,95	-20,50	9.329.163,72	1,34	476.018.609,99	1,96
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>43,38</b>	<b>-4,78</b>	<b>-16,99</b>	<b>162.847.826,02</b>	<b>23,32</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	5,92	0,09	0,02	3.886.591,12	0,56	159.012.460,09	2,44
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32,62	-4,88	0,56	14.709.937,39	2,11	992.571.971,59	1,48

## 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	32,00	-4,80	1,10	5.294.217,06	0,76	545.147.723,89	0,97
CEF	CEF	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,73	-0,45	1,41	18.152.262,18	2,60	505.717.833,93	3,59
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	36,22	-0,20	-0,20	2.694.540,75	0,39	56.847.219,78	4,74
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	2,24	-0,68	0,51	3.031.969,35	0,43	128.939.108,34	2,35
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>13,64</b>	<b>-2,43</b>	<b>0,91</b>	<b>47.769.517,85</b>	<b>6,84</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	9,30	-0,15	8,42	5.456.037,29	0,78	244.931.003,25	2,23
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	14,58	0,01	-1,57	2.820.888,97	0,40	85.896.067,12	3,28
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>7,87</b>	<b>-0,09</b>	<b>4,77</b>	<b>8.276.926,26</b>	<b>1,19</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	CEF	CXRI11	52,07	19,89	34,73	2.774.850,00	0,40	156.187.768,35	1,78
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>52,07</b>	<b>19,89</b>	<b>34,73</b>	<b>2.774.850,00</b>	<b>0,40</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>33,41</b>	<b>-3,94</b>	<b>-12,40</b>	<b>231.521.410,96</b>	<b>33,15</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,85%

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
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,45	3,00	26,58	13.091.998,47	1,87	830.681.972,32	1,58
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>29,45</b>	<b>3,00</b>	<b>26,58</b>	<b>13.091.998,47</b>	<b>1,87</b>		

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
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	31,96	-2,53	42,55	20.761.709,47	2,97	1.629.396.528,45	1,27
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>31,96</b>	<b>-2,53</b>	<b>42,55</b>	<b>20.761.709,47</b>	<b>2,97</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>31,73</b>	<b>-1,02</b>	<b>47,56</b>	<b>33.853.707,94</b>	<b>4,85</b>		
<b>Total</b>			<b>14,01</b>	<b>-1,84</b>	<b>-2,03</b>	<b>698.431.392,02</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	237.432.568,32	34,00	5,00	31,00	50,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	178.482.307,24	25,55	10,00	27,00	45,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	17.141.397,56	2,45	0,00	2,00	5,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>433.056.273,12</b>	<b>62,00</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	9.852.290,83	1,41	0,00	2,00	20,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	162.847.826,02	23,32	5,00	25,00	25,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	47.769.517,85	6,84	0,00	6,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	8.276.926,26	1,19	0,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.774.850,00	0,40	0,00	0,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>231.521.410,96</b>	<b>33,15</b>				35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	13.091.998,47	1,87	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	20.761.709,47	2,97	0,00	2,50	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>33.853.707,94</b>	<b>4,85</b>				10,00



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

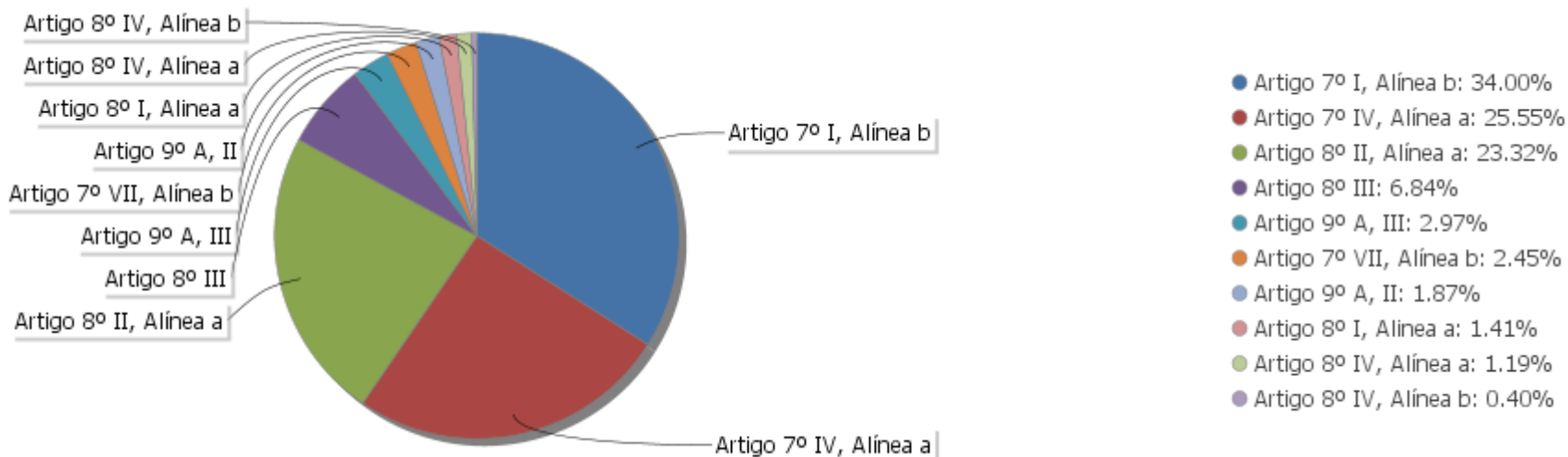
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,88 -560,83	2,78 121,98	0,60 117,07	4,54 363,37	5,20 146,70	-2.104.775,35	7.132.933,94
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,77 -490,90	0,71 31,21	0,58 113,37	3,61 288,53	2,90 81,75	-1.461.976,54	1.085.393,80
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,17 -106,56	3,72 163,27	2,06 402,84	6,29 503,15	5,71 161,28	-28.719,18	614.003,28
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,19 -0,39	-17,82 0,38	0,78 1,26	32,59 3,03	-9,28 0,40	-538.954,85	-2.136.172,19
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,78 0,02	-16,99 1,21	0,85 1,33	31,68 2,12	-6,29 3,40	-8.173.475,83	-28.755.906,83
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-2,43 2,37	0,91 19,11	3,07 3,55	11,45 -18,11	5,14 14,82	-1.124.716,46	402.846,96
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,09 4,70	4,77 22,97	-0,43 0,04	5,35 -24,21	5,95 15,63	-7.833,36	376.343,15
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	19,89 24,68	34,73 52,92	21,30 21,77	65,28 35,72	86,34 96,02	460.350,00	720.825,00
Artigo 9º A, II % do CDI	3,00 1.911,90	26,58 3.300,05	22,64 4.421,60			390.549,73	2.062.415,20
Artigo 9º A, III % do CDI	-2,53 -1.614,22	42,55 1.870,11	15,35 2.996,96	40,62 3.248,15	48,85 1.378,84	-539.749,64	6.197.509,94
<b>GUARUJÁ CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-13.129.301,48</b>	<b>-12.299.807,75</b>

## Análise de Liquidez

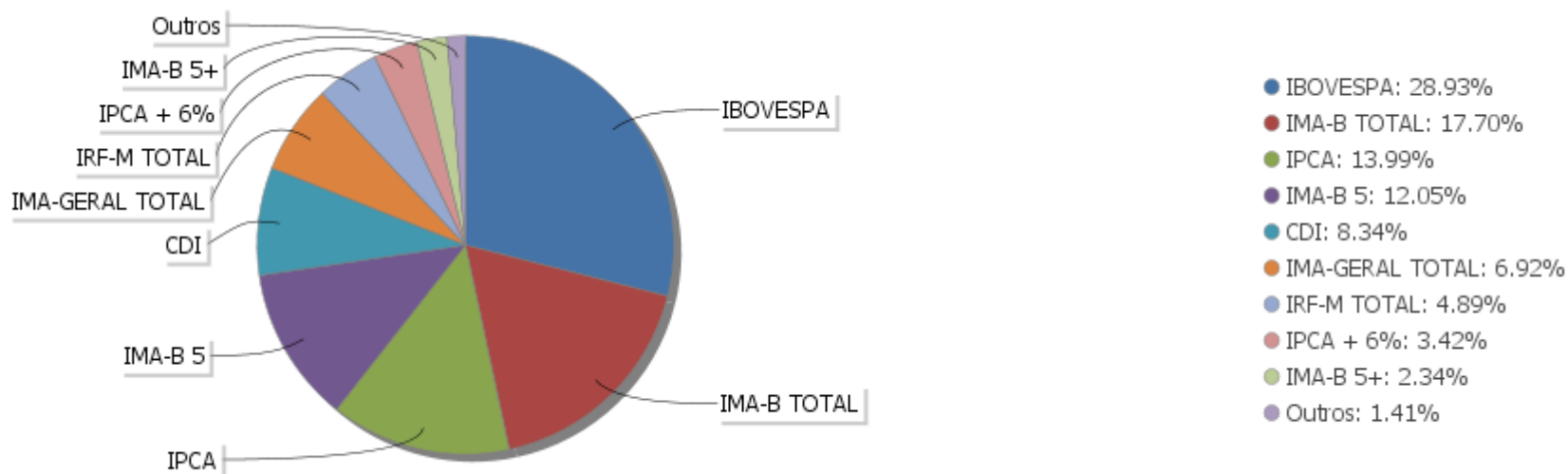
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	580.184.233,89	83,07	580.184.233,89	83,07
de 31 a 364 dias	78.158.805,58	11,19	658.343.039,47	94,26
acima de 365 dias	40.088.352,55	5,74	698.431.392,02	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

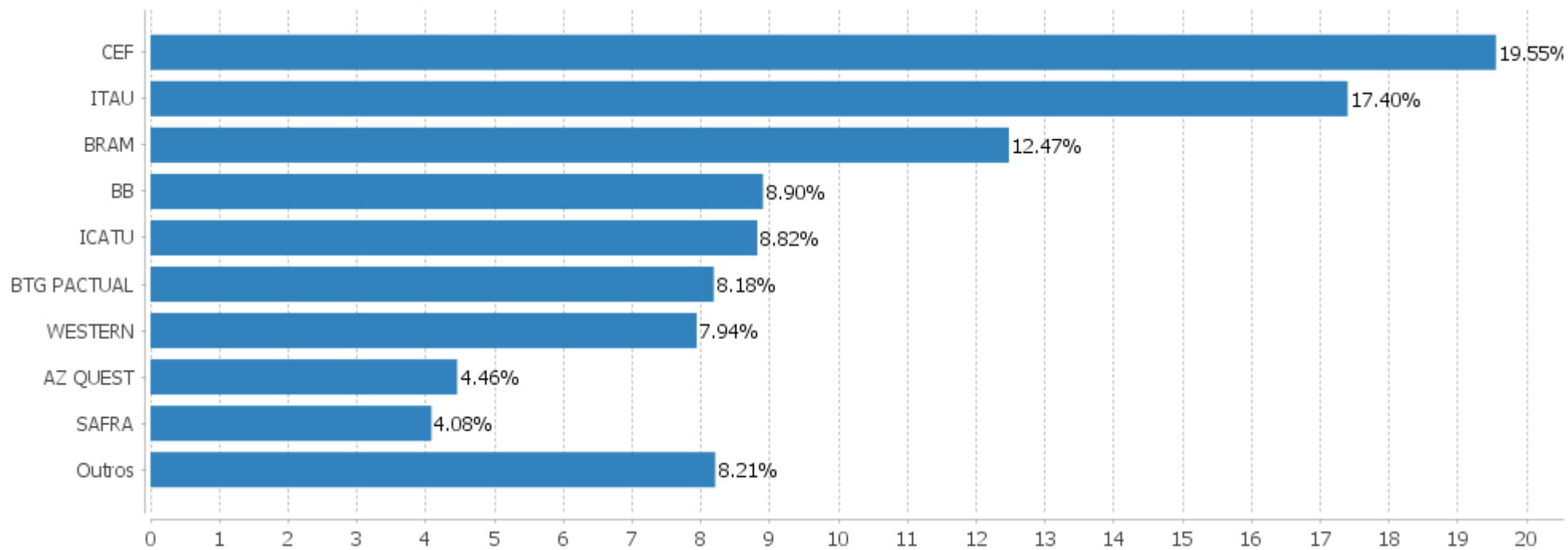


Alocação Por Estratégia



## 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	0,85	-1,89	-10,66	3,37	2,66	2,99	3,64	-0,32	-1,84				-2,03
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35				6,48
p.p. indexador	0,16	-2,47	-11,34	3,15	2,45	2,22	2,68	-1,16	-3,19				-8,51
2019	3,39	0,13	0,32	1,42	1,76	3,10	1,71	0,25	1,82	1,98	-0,17	2,74	20,00
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,52	-0,87	-0,90	0,33	1,10	2,65	1,07	-0,38	1,39	1,41	-1,18	1,03	9,22
2018	2,40	0,29	0,97	0,57	-2,68	0,14	2,00	-0,64	0,56	3,79	1,07	1,09	9,83
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,66	-0,31	0,41	-0,13	-3,60	-1,79	1,24	-1,17	-0,18	2,87	0,86	0,48	0,24

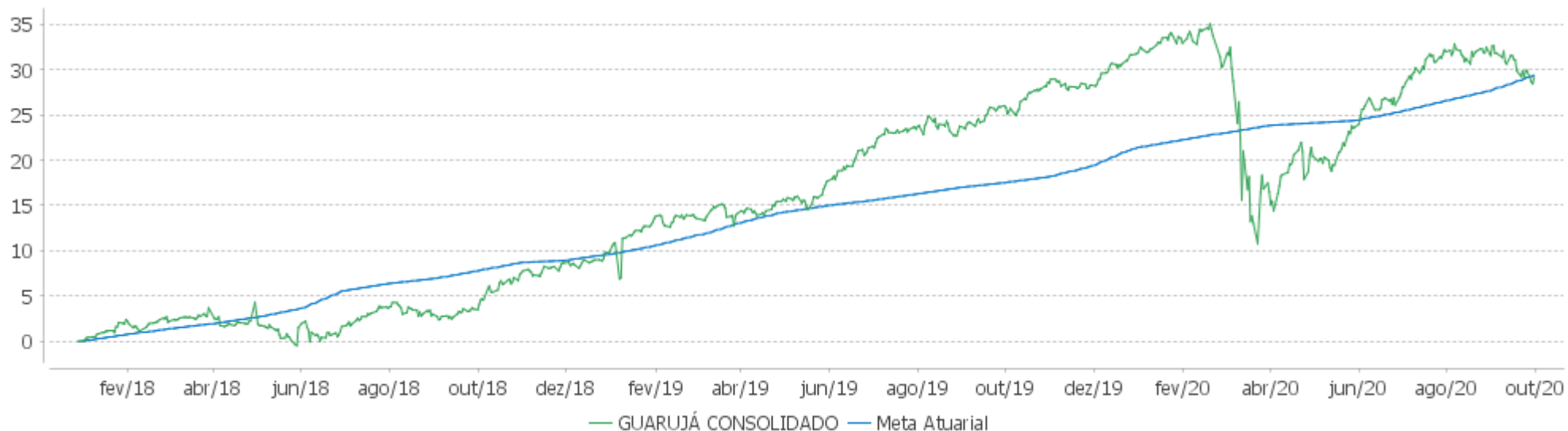
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

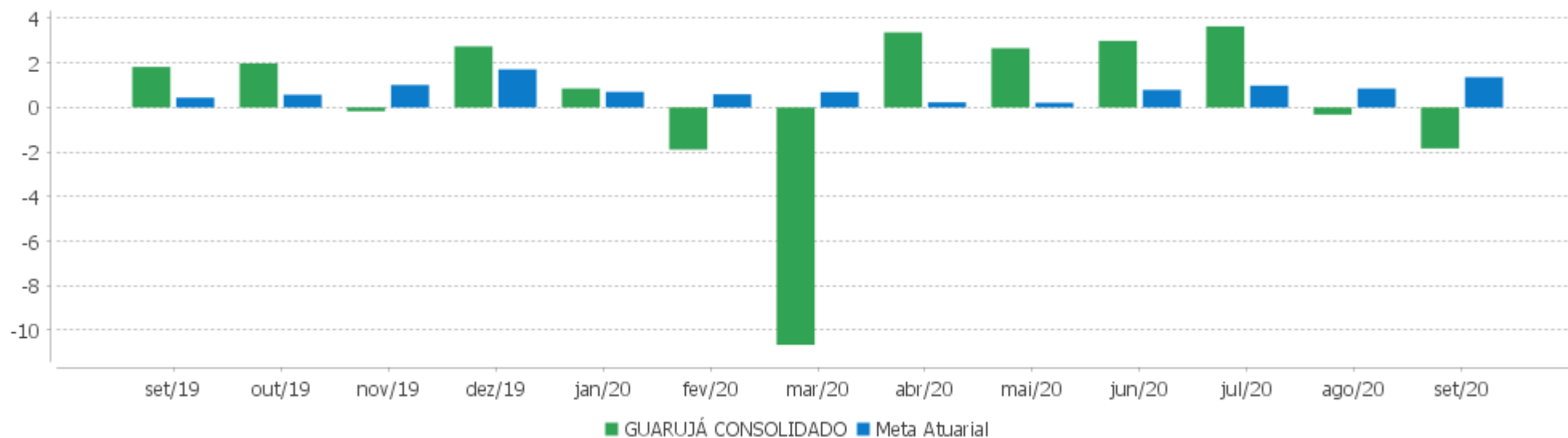
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	19	57,58	03 meses	1,41	3,19	-1,78	7,11
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	42,42	06 meses	10,83	4,43	6,40	9,15
			12 meses	2,48	10,02	-7,54	14,01
			24 meses	24,66	20,00	4,66	11,15
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,79	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,66	2020-03	Desde 29/12/2017	29,12	29,27	-0,15	10,07

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 INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,60 -0,09	-0,80 -0,08	0,92 -0,04	6,12 0,15	2,03 -0,08	34,42 0,28	37,01 -0,55
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,19 -0,06	4,48 -0,02	1,21 -0,08	5,10 -0,01	7,13 -0,11	23,57 -0,19	31,06 -0,78
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,67 -1.062,65	0,38 16,84	0,72 141,56	5,96 476,77	3,18 89,80	37,20 370,61	40,10 231,03
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	-0,00 -0,19	1,42 62,49	0,18 34,55	0,66 53,10	2,40 67,81	7,66 76,30	13,60 78,36
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	-0,88 -1,52	2,89 2,04	-0,03 -1,28	2,85 2,04			
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,23 -0,87	2,47 1,12	0,20 -1,05	1,32 0,51	3,69 0,56	17,87 11,75	25,30 14,38
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,51 0,08	2,72 0,32	0,72 0,19	3,82 0,39	4,70 0,35	22,49 0,64	28,74 0,32
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 55,34	1,64 71,97	0,29 57,43	0,83 66,45	2,68 75,66	8,21 81,83	14,47 83,39
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,81 -0,69	5,51 1,00	0,67 -0,63	5,99 0,88	8,50 1,26	30,69 6,93	38,27 6,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	4,29 -0,22	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,19 0,32	5,23 0,73	1,81 0,51	5,65 0,54	7,79 0,55	27,37 3,62	33,98 2,14
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,22 -0,10	4,22 -0,29	1,13 -0,16	4,93 -0,18	6,86 -0,38	23,24 -0,52	31,15 -0,69
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,19 -0,94	4,71 -1,13	1,65 -1,13	5,20 1,41	7,26 -2,06	25,36 6,15	43,00 11,01
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,12 -0,60	-0,22 0,50	0,45 -0,51	5,97 0,00	2,89 0,78	38,19 4,05	40,35 2,78
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,61 -0,01	1,92 -0,49	0,30 -0,22	3,01 -0,42	3,80 -0,55	20,81 -1,04	26,70 -1,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,61 -0,05	4,41 -0,20	-0,30 -0,07	3,01 -0,13	6,31 -0,25	24,12 -0,38	30,74 -0,90
BB PREV IPCA II							

## 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.							
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,26 1,26	3,97 4,68	1,04 0,08	4,82 -1,15	6,65 4,55	25,37 -8,77	31,82 -5,75
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 1,70	2,64 3,36	0,98 0,02	3,41 -2,56	5,12 3,01	17,74 -16,40	26,32 -11,25
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,92 -0,40	1,00 1,72	0,22 -0,74	6,48 0,52	2,76 0,65	38,95 4,81	40,17 2,60
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,30 -1,43	5,57 -0,28	1,48 -1,30	6,07 2,28	8,40 -0,92	30,87 11,66	36,57 4,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	4,53 3,19	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	4,64 5,36	0,74 -0,22	5,94 -0,03	7,67 5,56	33,02 -1,12	36,94 -0,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,04 0,02	4,84 -0,57	1,66 -0,33	5,27 -0,15	7,35 -0,65	20,53 -1,35	29,77 -2,49
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,04	-0,93 -0,21	0,83 -0,13	5,77 -0,20	1,83 -0,28	33,39 -0,75	36,49 -1,07
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,92 -0,40	1,01 1,73	0,22 -0,74	6,49 0,52	2,77 0,66	39,00 4,86	40,24 2,68
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,62 -0,02	-4,85 -0,30	0,70 -0,05	6,60 -0,18	-2,01 -0,34	41,49 -0,93	39,96 -1,30
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,03	-1,17 -0,45	0,88 -0,08	5,75 -0,21	1,58 -0,53	33,11 -1,03	36,13 -1,43
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	-0,20 -0,07	3,58 -0,93	2,29 1,00	6,72 1,61	5,44 -1,80	21,46 -2,30	30,37 -1,47
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	-0,08 -1,21	4,11 -1,73	1,40 -1,38	5,06 1,27	6,65 -2,68	21,92 2,71	31,74 -0,25
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do CDI	0,09 59,11	0,02 1,07	0,57 111,26	6,48 518,27	0,97 27,26	6,53 65,08	14,27 82,19
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,68 -432,62	0,51 22,33	0,20 39,77	0,95 76,10	1,77 50,09	8,33 82,97	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-4,88 -3.106,08	0,56 24,45	7,43 1.451,94	27,61 2.207,30	9,43 266,17	16,25 161,91	40,14 231,23
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-4,93 -0,13	-12,28 5,92	-0,50 -0,02	17,77 -11,79			
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	-0,45	1,41	-0,37	0,25	2,97	15,39	



## 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.	4,35	19,61	0,11	-29,31	12,65	-3,84	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-4,80 0,00	1,10 19,29	7,41 7,89	27,36 -2,20	9,96 19,64	16,39 -2,84	40,48 13,14
DAYC IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-5,32 -0,53	-17,55 0,64	1,28 1,75	33,82 4,26	-9,00 0,69	25,35 6,11	32,63 5,30
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	-4,81 -0,01	-18,40 -0,20	-0,56 -0,08	29,33 -0,23	-9,91 -0,23	18,74 -0,49	26,56 -0,78
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP % do CDI	0,01 8,53	-1,57 -69,12	-0,41 -79,98	-0,83 -66,23	3,13 88,37	11,39 113,45	11,81 68,06
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,15 -95,73	8,42 370,14	-0,45 -87,22	8,90 711,58	7,94 224,03	20,51 204,32	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,97 1,83	-4,02 14,18	4,71 5,18	48,34 18,78	5,55 15,24	60,69 41,45	61,87 34,53
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,10 0,70	-14,43 3,76	1,33 1,81	40,29 10,73	-4,88 4,81	30,17 10,94	23,15 -4,19
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,50 0,29	-20,92 -2,73	-2,89 -2,41	20,12 -9,43	-6,28 3,40	46,96 27,72	47,91 20,57
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-8,03 -3,24	-33,17 -14,98	-6,52 -6,04	24,90 -4,66	-23,46 -13,78	13,87 -5,36	19,15 -8,18
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,45 0,35	-15,69 2,51	2,15 2,63	31,96 2,40	-5,14 4,54	23,13 3,89	36,96 9,62
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	-5,95 -0,52	-17,96 0,97	3,71 1,44	32,67 -2,83			
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,27 0,52	-20,98 -2,79	2,37 2,85	31,68 2,12	-11,99 -2,31	20,08 0,85	24,09 -3,25
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,97 -1,17	-17,19 1,00	3,84 4,32	32,93 3,37	-0,95 8,73	56,53 37,30	58,27 30,93
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-4,96	-20,69	2,00	30,39	-10,53	31,29	43,75
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,41 -0,62	-24,63 -6,44	-5,72 -5,25	14,18 -15,38	-17,08 -7,40	31,03 11,80	33,96 6,62
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,72 -0,93	-12,17 6,02	1,29 1,77	31,74 2,18	-5,89 3,79	33,07 13,83	49,81 22,47
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,93 -0,14	-16,09 2,10	-2,16 -1,68	22,60 -6,96	-7,44 2,24	31,32 12,09	21,83 -5,51
CXRI11 Var. IBOVESPA p.p.	19,89 24,68	34,73 52,92	21,30 21,77	65,28 35,72	86,34 96,02	130,11 110,88	99,79 72,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-2,53 2,26	42,55 60,75	15,35 15,82	40,62 11,07	48,85 58,54	70,31 51,08	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	3,00 1,87	86,27 80,42	22,64 19,86	64,22 60,43			
GUARUJÁ CONSOLIDADO Var. INPC + 6% p.p.	-1,84 -3,20	-2,03 -8,61	1,41 -1,81	10,83 6,34	2,48 -7,64	24,66 4,55	
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Indexadores**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA-C TOTAL	2,95	17,78	9,60	18,32	19,95	48,39	67,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	1,96	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14
SELIC	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

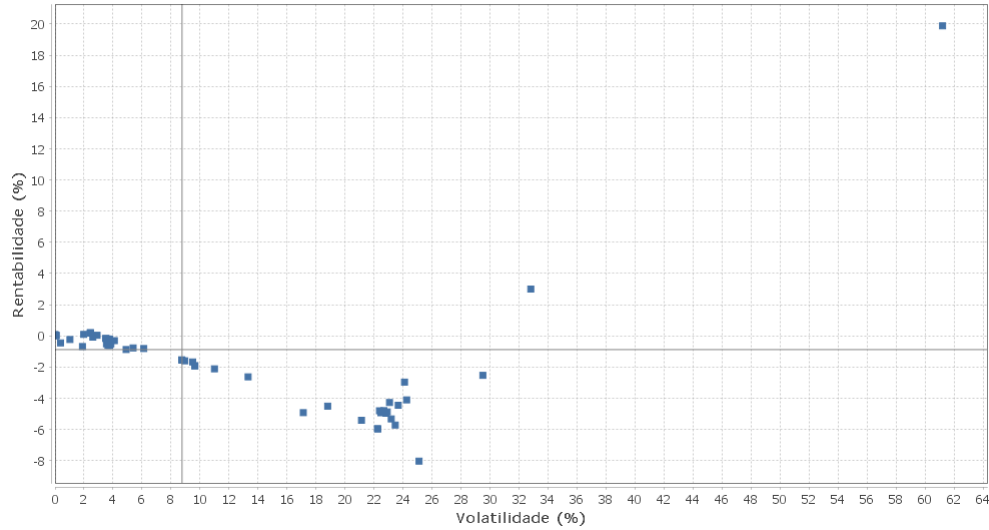
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
242	01/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	19.679,16	0,00	9.327,79482400	2,1097333690
250	01/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	143.287,82	0,00	67.917,50185300	2,1097333690
238	04/09/2020	BB PREV IPCA II	0,00	728.793,79	362.652,64962822	2,0096193720
241	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	728.793,79	0,00	345.407,94635000	2,1099508500
243	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.531.580,08	0,00	1.673.773,62368400	2,1099508500
258	04/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.095,43	0,00	584,09849500	1,8754200000
251	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.497.667,91	0,00	2.131.645,82009100	2,1099508500
244	09/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	31,35	0,00	14,85720200	2,1100876500
252	09/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	41,80	0,00	19,80960300	2,1100876500
246	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	88.152,21	41.775,30414000	2,1101512440
254	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	532.032,53	252.130,04589700	2,1101512440
259	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	10.500,00	0,00	5.597,82058100	1,8757300000
247	22/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.089.008,28	990.028,86499500	2,1100478520
255	22/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.637.879,43	776.228,57152200	2,1100478520
260	23/09/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.088.997,83	0,00	11.247,07022333	185,7370665000
261	23/09/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.637.868,98	0,00	8.818,21281483	185,7370665000
248	25/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.513.424,92	717.242,83937700	2,1100592950
256	25/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.186.595,98	562.351,95987700	2,1100592950
239	28/09/2020	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1.513.414,47	0,00	1.723.869,25555160	0,8779172000
240	28/09/2020	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1.186.585,53	0,00	1.351.591,61934630	0,8779172000
249	29/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	187.590,86	88.914,48052800	2,1097897540
257	29/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.177.521,99	558.122,90668700	2,1097897540
245	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	20.650,90	0,00	9.788,76970700	2,1096522460
253	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	35.079,68	0,00	16.628,18128700	2,1096522460

**Total**

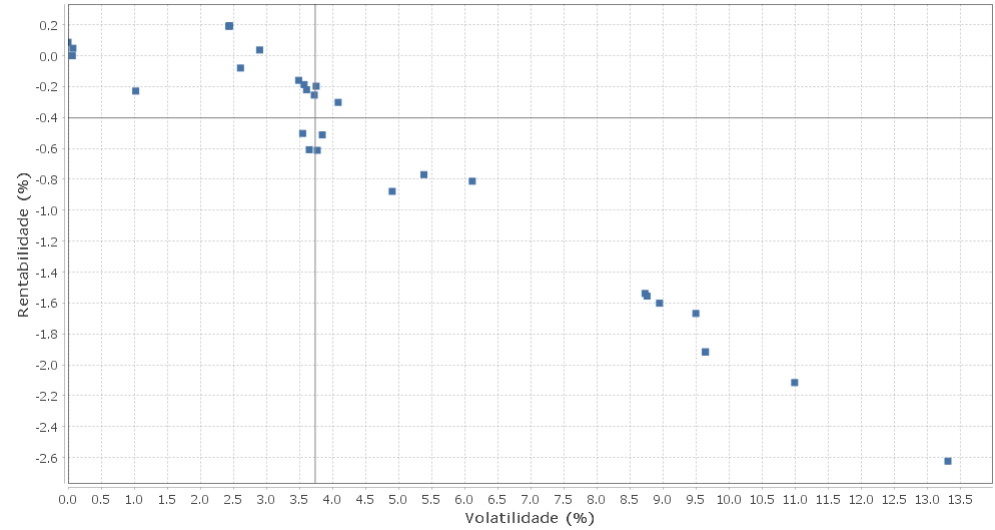
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

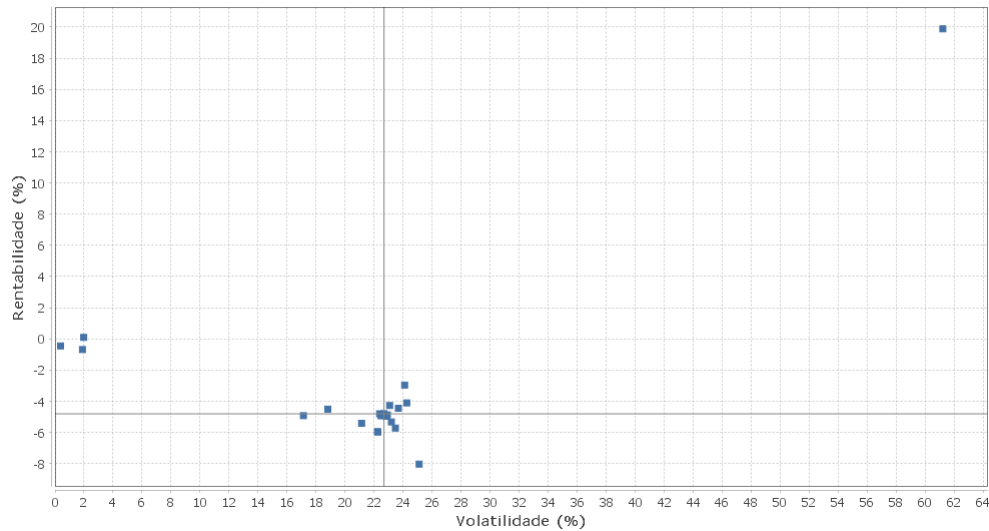
GUARUJÁ CONSOLIDADO - No Mês



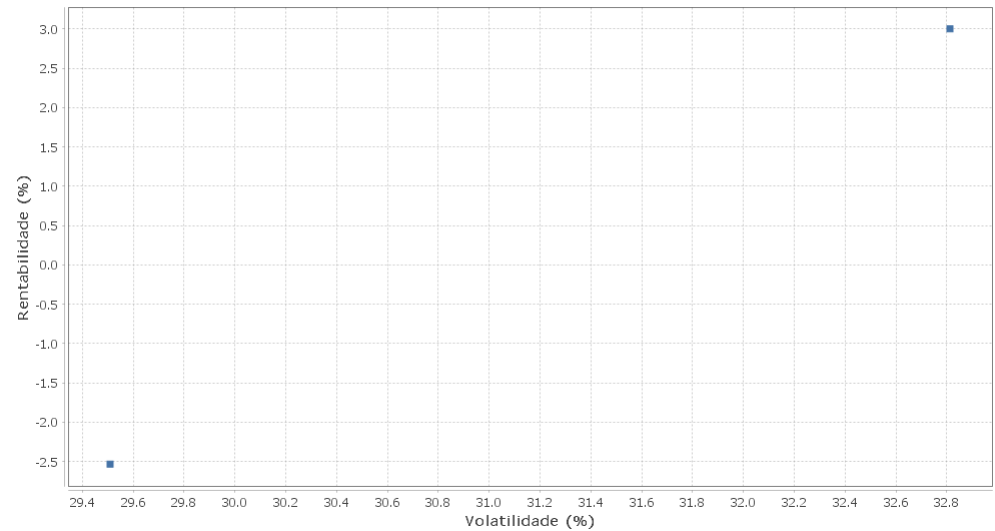
Renda Fixa - No Mês



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\$): 26.815.261,66

Value-At-Risk: 3,84%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-140,08	0,09	447.358,83	0,06
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	1.803.072,08	0,26
BB PREV IPCA II	Artigo 7º I, Alínea b	0,07	NaN	0,00	-1,47	0,05	0,00	0,00
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,38	0,16	0,00	-1,57	-0,45	18.152.262,18	2,60
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,02	0,41	0,03	-0,38	-0,23	64.426.915,82	9,22
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,89	0,65	0,00	-0,44	-0,68	3.031.969,35	0,43
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,98	1,06	0,00	-0,03	0,09	3.886.591,12	0,56
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	0,55	0,00	0,01	0,19	3.400.161,84	0,49
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	0,97	0,00	0,01	0,19	1.357.591,03	0,19
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	0,98	0,00	0,01	0,19	3.795.367,41	0,54
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,61	0,87	0,00	-0,09	-0,08	4.371.434,97	0,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,03	0,01	-0,04	0,04	15.110.392,35	2,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,02	-0,09	-0,16	19.827.431,90	2,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,03	-0,19	-0,50	20.855.985,82	2,99
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	3,57	1,07	0,01	-0,10	-0,19	5.580.338,98	0,80
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	1,08	0,01	-0,10	-0,22	8.713.271,43	1,25
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,31	0,02	-0,21	-0,61	11.051.744,23	1,58
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,72	1,11	0,01	-0,11	-0,26	5.700.028,30	0,82
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	3,75	1,21	0,02	-0,09	-0,20	12.769.962,59	1,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,77	1,39	0,05	-0,20	-0,61	32.358.893,42	4,63
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,85	1,35	0,05	-0,17	-0,51	34.739.031,06	4,97
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	4,09	1,32	0,00	-0,11	-0,30	3.791.428,95	0,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	4,90	1,54	0,01	-0,21	-0,88	7.327.910,93	1,05
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	1,83	0,01	-0,17	-0,77	7.853.872,31	1,12
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,12	2,00	0,06	-0,16	-0,81	29.062.370,38	4,16
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,73	3,23	0,08	-0,19	-1,54	22.978.004,95	3,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,76	3,22	0,10	-0,20	-1,56	28.424.903,18	4,07
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	8,95	3,31	0,15	-0,20	-1,60	41.135.663,53	5,89

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	9,50	3,28	0,08	-0,19	-1,67	23.022.016,01	3,30
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	9,64	4,04	0,01	-0,22	-1,92	1.799.487,75	0,26
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	9,64	4,04	0,02	-0,22	-1,92	4.362.430,45	0,62
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	10,99	3,74	0,01	-0,21	-2,12	1.474.343,47	0,21
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	13,31	5,08	0,09	-0,21	-2,62	15.514.859,15	2,22
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	17,12	7,23	0,03	-0,30	-4,93	2.694.540,75	0,39
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	18,81	10,59	0,13	-0,25	-4,50	9.175.701,76	1,31
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,13	12,45	0,33	-0,26	-5,41	19.752.907,08	2,83
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,24	11,98	0,14	-0,27	-5,95	9.329.163,72	1,34
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,26	12,02	0,31	-0,28	-5,97	20.695.676,76	2,96
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	22,38	11,57	0,04	-0,22	-4,81	2.626.322,38	0,38
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	22,47	10,92	0,10	-0,23	-4,93	7.004.976,48	1,00
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	22,68	10,74	0,05	-0,22	-4,80	5.294.217,06	0,76
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,82	12,64	0,37	-0,22	-4,96	21.600.674,98	3,09
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	22,91	11,00	0,14	-0,22	-4,88	14.709.937,39	2,11
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,07	11,01	0,02	-0,19	-4,27	1.264.532,88	0,18
DAYC IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	23,19	11,44	0,11	-0,24	-5,32	7.225.968,45	1,03
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,46	10,99	0,13	-0,25	-5,72	8.915.727,93	1,28
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,67	12,50	0,10	-0,19	-4,45	5.665.553,65	0,81
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,11	12,00	0,73	-0,13	-2,97	45.377.147,23	6,50
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,25	12,40	0,10	-0,18	-4,10	5.870.443,75	0,84
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,10	14,72	0,16	-0,33	-8,03	8.195.319,80	1,17
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	29,51	11,58	0,04	-0,09	-2,53	20.761.709,47	2,97
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	32,81	15,36	-0,06	0,09	3,00	13.091.998,47	1,87
CXRI11	Artigo 8º IV, Alínea b	61,21	1,96	0,00	0,32	19,89	2.774.850,00	0,40