



**LDB**  
EMPRESAS

**GUARUJÁ CONSOLIDADO**  
DEZEMBRO 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 31.12.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

59,44%

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	5,23	1,81	7,65	9.000.360,49	1,16	872.184.819,46	1,03
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,68	5,53	7,24	1.584.657,96	0,21	1.130.429.213,40	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	30.452.942,55	3,94	8.693.778.987,76	0,35
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	19,86	7,50	5,10	17.137.452,70	2,22	924.231.847,02	1,85
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,52	2,11	4,82	11.366.228,07	1,47	1.195.459.257,45	0,95
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	20.485.304,75	2,65	20.761.505.098,56	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,78	4,83	5,85	24.610.078,83	3,18	1.116.892.204,20	2,20
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	15.570.940,50	2,01	10.655.087.063,09	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	1,96	6,43	32.984.020,66	4,27	3.566.953.490,56	0,92
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,23	3,24	3,54	30.350.628,67	3,93	941.494.565,53	3,22
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,10	1,97	8,65	3.805.875,90	0,49	351.497.044,54	1,08
BB	BB	BB PREV RF VII	2,43	1,21	5,61	3.498.549,16	0,45	245.863.748,76	1,42
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,22	1,82	7,48	5.892.730,55	0,76	436.337.264,96	1,35
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,92	1,21	8,29	3.905.559,81	0,51	203.620.845,38	1,92
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	21.281.728,03	2,75	14.722.139.597,34	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,71	2,53	8,76	8.163.037,43	1,06	1.463.442.575,00	0,56
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,90	5,52	9,32	1.947.681,84	0,25	71.349.252,27	2,73
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	13,90	5,52	9,33	4.721.839,21	0,61	383.439.882,64	1,23
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,39	1,21	7,76	1.397.047,19	0,18	470.288.944,40	0,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,81</b>	<b>3,13</b>	<b>6,86</b>	<b>248.156.664,30</b>	<b>32,10</b>		

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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,55	4,94	7,53	24.660.790,87	3,19	637.293.736,31	3,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,97	2,08	5,84	35.792.638,40	4,63	763.957.366,29	4,69
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,31	4,94	6,30	44.079.847,54	5,70	2.099.544.961,17	2,10
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,10	1,64	2.570.104,32	0,33	2.452.222.466,54	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,09	1,90	14.400,02	0,00	910.358.895,05	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,38	1,78	7,86	9.142.202,52	1,18	954.945.016,55	0,96
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	64.674.825,07	8,37	3.882.685.363,65	1,67
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5,90	2,70	2,86	7.595.868,50	0,98	2.667.113.282,02	0,28
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,92	0,16	0,16	4.965.960,92	0,64	2.099.340.126,69	0,24
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>6,54</b>	<b>2,36</b>	<b>4,88</b>	<b>193.496.638,16</b>	<b>25,03</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	4,50	1,88	7,96	4.532.974,76	0,59	626.431.567,64	0,72
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	6,08	2,37	7,60	13.265.419,50	1,72	825.779.381,34	1,61
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>5,64</b>	<b>2,25</b>	<b>7,69</b>	<b>17.798.394,26</b>	<b>2,30</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,18</b>	<b>2,77</b>	<b>6,06</b>	<b>459.451.696,72</b>	<b>59,44</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

34,78%

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	45,19	9,29	2,59	3.301.730,89	0,43	362.502.538,59	0,91
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	46,50	8,85	1,23	8.872.233,67	1,15	201.805.256,91	4,40
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>46,08</b>	<b>8,97</b>	<b>1,55</b>	<b>12.173.964,56</b>	<b>1,57</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	43,68	7,61	-6,07	1.503.201,55	0,19	601.590.009,52	0,25
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,19	7,96	-9,45	23.733.315,65	3,07	1.793.128.513,73	1,32
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	41,38	6,00	-1,74	8.203.579,65	1,06	111.432.252,33	7,36
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	41,21	6,28	15,29	10.880.702,29	1,41	1.217.691.164,96	0,89
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,24	6,93	-3,16	24.202.486,63	3,13	1.356.738.390,13	1,78
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	48,55	8,26	1,65	6.973.444,79	0,90	179.383.454,35	3,89
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,05	5,23	7,88	56.599.996,14	7,32	2.636.774.357,29	2,15
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,98	8,80	5,70	7.102.872,08	0,92	1.024.114.802,80	0,69
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,06	10,11	6,74	10.949.851,83	1,42	1.060.739.165,08	1,03
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,19	6,30	-4,87	25.907.944,98	3,35	3.595.641.284,57	0,72
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,63	7,97	-21,23	9.659.879,20	1,25	1.462.115.658,32	0,66
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	46,52	6,93	-7,00	10.912.877,48	1,41	556.827.248,63	1,96
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>44,13</b>	<b>6,74</b>	<b>-2,65</b>	<b>196.630.152,27</b>	<b>25,44</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	5,95	0,58	0,46	3.903.570,94	0,51	133.102.799,66	2,93
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	33,38	3,19	12,17	23.572.305,79	3,05	1.201.804.027,43	1,96

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	32,77	3,07	12,58	19.132.431,65	2,48	734.034.454,86	2,61
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	32,24	6,22	15,80	3.126.675,60	0,40	70.902.006,44	4,41
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	2,29	0,71	2,28	0,00	0,00	134.791.131,54	0,00
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>14,87</b>	<b>3,01</b>	<b>9,87</b>	<b>49.734.983,98</b>	<b>6,43</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	9,27	-0,18	7,80	5.424.830,16	0,70	243.530.060,71	2,23
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	9,84	-0,22	-2,00	2.808.536,89	0,36	85.519.947,55	3,28
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>6,92</b>	<b>-0,19</b>	<b>4,22</b>	<b>8.233.367,05</b>	<b>1,07</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	50,58	-4,50	1,00	2.052.750,00	0,27	153.040.983,83	1,34
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>50,58</b>	<b>-4,50</b>	<b>1,00</b>	<b>2.052.750,00</b>	<b>0,27</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>34,25</b>	<b>5,80</b>	<b>0,56</b>	<b>268.825.217,86</b>	<b>34,78</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,78%

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	29,49	0,18	30,01	20.184.284,19	2,61	1.275.079.811,13	1,58
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>29,49</b>	<b>0,18</b>	<b>30,01</b>	<b>20.184.284,19</b>	<b>2,61</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	33,07	0,35	44,45	24.502.275,56	3,17	1.875.936.369,20	1,31
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>33,07</b>	<b>0,35</b>	<b>44,45</b>	<b>24.502.275,56</b>	<b>3,17</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>32,71</b>	<b>0,29</b>	<b>50,18</b>	<b>44.686.559,75</b>	<b>5,78</b>		
<b>Total</b>			<b>14,37</b>	<b>3,68</b>	<b>5,30</b>	<b>772.963.474,33</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	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	248.156.664,30	32,10	5,00	31,00	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	193.496.638,16	25,03	10,00	27,00	45,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	17.798.394,26	2,30	0,00	2,00	5,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>459.451.696,72</b>	<b>59,44</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	12.173.964,56	1,57	0,00	2,00	20,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	196.630.152,27	25,44	5,00	25,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	49.734.983,98	6,43	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	8.233.367,05	1,07	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.052.750,00	0,27	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>268.825.217,86</b>	<b>34,78</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	20.184.284,19	2,61	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	24.502.275,56	3,17	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>44.686.559,75</b>	<b>5,78</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	3,13 1.903,30	6,86 248,63	4,56 966,36	5,18 525,75	6,86 248,63	7.531.589,58	16.488.616,30
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,36 1.435,47	4,88 177,06	3,45 731,61	4,05 410,82	4,88 177,06	4.456.513,34	8.967.205,56
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	2,25 1.366,05	7,69 278,85	3,83 812,63	5,97 605,87	7,69 278,85	391.055,59	1.270.999,98
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,97 -0,33	1,55 -1,37	23,56 -2,24	24,53 -0,68	1,55 -1,37	1.001.811,05	185.501,54
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	6,74 -2,56	-2,65 -5,56	17,15 -8,66	18,15 -7,06	-2,65 -5,56	12.413.380,72	26.419,42
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,01 -6,29	9,87 6,95	8,88 -16,93	12,22 -12,99	9,87 6,95	1.442.415,11	4.819.857,23
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,19 -9,49	4,22 1,31	-0,53 -26,33	-0,96 -26,17	4,22 1,31	-15.970,29	332.783,94
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-4,50 -13,80	1,00 -1,91	-25,03 -50,84	-9,06 -34,27	1,00 -1,91	-96.750,00	30.225,00
Artigo 9º A, II % do CDI	0,18 106,87	30,01 2.342,43	2,70 573,42	25,96 2.632,35		35.412,44	2.521.715,54
Artigo 9º A, III % do CDI	0,35 210,94	44,45 1.611,74	1,33 281,95	16,88 1.711,77	44,45 1.611,74	177.844,78	6.578.716,29
<b>GUARUJÁ CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>27.337.302,32</b>	<b>41.222.040,80</b>

## 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 RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1.380.320,10	0,00	0,00	0,00	1.397.047,19	16.727,09	110.872,03
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	29.048.219,33	0,00	0,00	0,00	30.452.942,55	1.404.723,22	1.761.744,11
BB PREV RF IPCA	3.732.378,63	0,00	0,00	0,00	3.805.875,90	73.497,27	309.732,39
BB PREV RF VII	3.456.843,32	0,00	0,00	0,00	3.498.549,16	41.705,84	329.597,46
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5.787.332,58	0,00	0,00	0,00	5.892.730,55	105.397,97	487.001,44

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	3.858.858,37	0,00	0,00	0,00	3.905.559,81	46.701,44	304.403,43
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	4.474.687,75	0,00	0,00	0,00	4.721.839,21	247.151,46	408.576,10
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.961.388,15	0,00	0,00	0,00	8.163.037,43	201.649,28	670.192,45
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1.845.769,50	0,00	0,00	0,00	1.947.681,84	101.912,34	168.353,91
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.317.789,07	0,00	0,00	0,00	15.570.940,50	253.151,43	1.157.638,60
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.131.709,84	0,00	0,00	0,00	11.366.228,07	234.518,23	522.612,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.119.176,91	0,00	0,00	0,00	20.485.304,75	366.127,84	2.024.346,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.349.370,01	0,00	0,00	0,00	32.984.020,66	634.650,65	1.762.574,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	21.004.331,59	0,00	0,00	0,00	21.281.728,03	277.396,44	1.141.867,84
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	8.840.318,88	0,00	0,00	0,00	9.000.360,49	160.041,61	639.859,14
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	15.941.212,54	0,00	0,00	0,00	17.137.452,70	1.196.240,16	831.182,51
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.501.585,61	0,00	0,00	0,00	1.584.657,96	83.072,35	107.026,97
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	23.476.574,55	0,00	0,00	0,00	24.610.078,83	1.133.504,28	1.360.571,47
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	29.397.207,99	0,00	0,00	0,00	30.350.628,67	953.420,68	1.038.922,97
					248.156.664,30	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 RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	7.396.424,06	0,00	0,00	0,00	7.595.868,50	199.444,44	211.092,65
BB PREV RF FLUXO FIC	8.959.849,16	8.896.013,53	-15.292.630,58	0,00	2.570.104,32	6.872,21	119.441,75
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.659.850,16	3.336.008,11	0,00	0,00	9.142.202,52	146.344,25	465.286,66
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	35.064.586,78	0,00	0,00	0,00	35.792.638,40	728.051,62	1.975.019,67
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	42.003.300,00	0,00	0,00	0,00	44.079.847,54	2.076.547,54	2.612.941,10
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.235.928,58	13.796,29	-1.235.434,89	0,00	14.400,02	110,04	37.364,62
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	64.544.342,36	0,00	0,00	0,00	64.674.825,07	130.482,71	1.799.361,36
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,00	4.957.813,08	0,00	0,00	4.965.960,92	8.147,84	8.147,84
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	23.500.278,18	0,00	0,00	0,00	24.660.790,87	1.160.512,69	1.726.672,42
					193.496.638,16	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.449.118,83	0,00	0,00	0,00	4.532.974,76	83.855,93	334.214,49
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	12.958.219,84	0,00	0,00	0,00	13.265.419,50	307.199,66	936.785,49
					17.798.394,26	0,00	0,00

## Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	3.020.935,56	0,00	0,00	0,00	3.301.730,89	280.795,33	83.357,14
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	8.151.217,95	0,00	0,00	0,00	8.872.233,67	721.015,72	102.144,40
					12.173.964,56	0,00	0,00

## Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	22.634.890,93	0,00	0,00	0,00	24.202.486,63	1.567.595,70	-789.555,05
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	10.205.978,51	0,00	0,00	0,00	10.912.877,48	706.898,97	-14.122,52
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	6.528.484,69	0,00	0,00	0,00	7.102.872,08	574.387,39	383.038,68
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	53.784.659,07	0,00	0,00	0,00	56.599.996,14	2.815.337,07	4.629.402,30
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	7.739.437,58	0,00	0,00	0,00	8.203.579,65	464.142,07	-145.087,89
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	10.237.400,65	0,00	0,00	0,00	10.880.702,29	643.301,64	1.275.527,38
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	21.982.467,93	0,00	0,00	0,00	23.733.315,65	1.750.847,72	-2.475.805,14
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	24.373.547,43	0,00	0,00	0,00	25.907.944,98	1.534.397,55	-1.327.350,67
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	8.946.870,96	0,00	0,00	0,00	9.659.879,20	713.008,24	-2.457.889,51
OCCAM FIC FIA	9.944.547,85	0,00	0,00	0,00	10.949.851,83	1.005.303,98	932.429,23
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	1.396.855,00	0,00	0,00	0,00	1.503.201,55	106.346,55	-97.158,32
WA ASSET VALUATION FIA	6.441.630,95	0,00	0,00	0,00	6.973.444,79	531.813,84	112.990,93
					196.630.152,27	0,00	0,00

## Artigo 8º III

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	2.943.531,91	0,00	0,00	0,00	3.126.675,60	183.143,69	426.675,60
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	3.063.782,76	0,00	-3.085.498,78	0,00	0,00	21.716,02	68.854,25
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13.012.167,18	5.633.954,64	0,00	0,00	19.132.431,65	486.309,83	1.653.817,52
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	3.880.881,18	0,00	0,00	0,00	3.903.570,94	22.689,76	17.923,30
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	22.843.749,98	0,00	0,00	0,00	23.572.305,79	728.555,81	2.443.736,92
					49.734.983,98	0,00	0,00

## Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	2.814.727,21	0,00	0,00	0,00	2.808.536,89	-6.190,32	-59.833,30
FIP LA SHOPPING CENTERS	5.434.610,13	0,00	0,00	0,00	5.424.830,16	-9.779,97	392.617,24
					8.233.367,05	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\$)
CXRI11	2.160.000,00	0,00	0,00	0,00	10.500,00	2.052.750,00	-96.750,00	30.225,00
						2.052.750,00	0,00	0,00

## Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.148.871,75	0,00	0,00	0,00	20.184.284,19	35.412,44	2.521.715,54
					20.184.284,19	0,00	0,00

## Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	20.965.071,04	3.359.359,74	0,00	0,00	24.502.275,56	177.844,78	6.578.716,29
					24.502.275,56	0,00	0,00

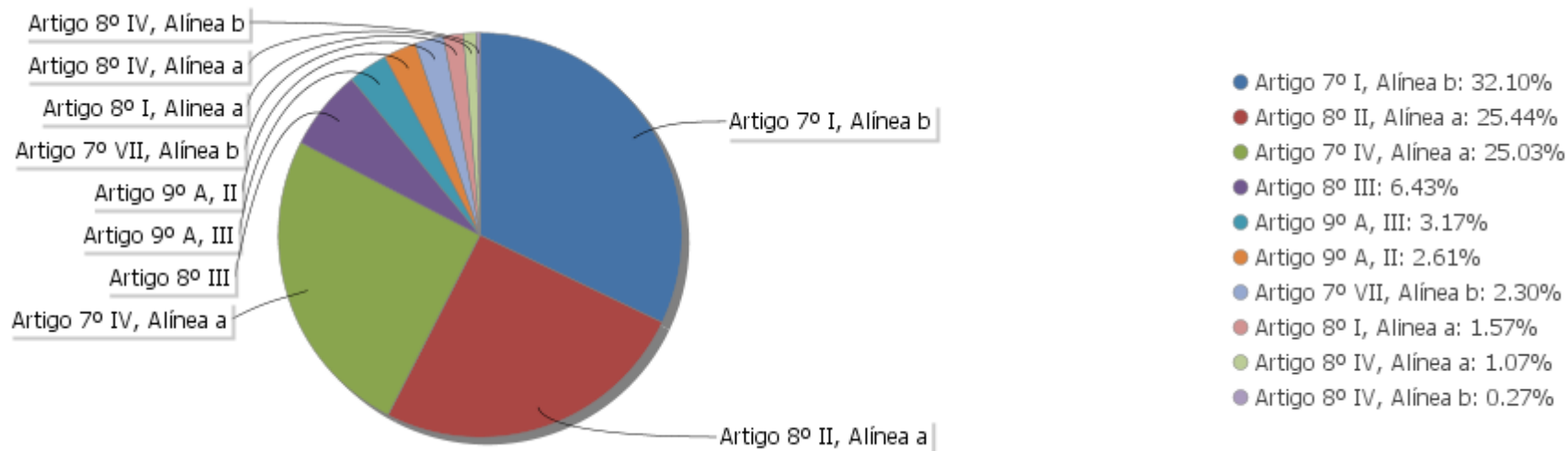
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Liquidez**

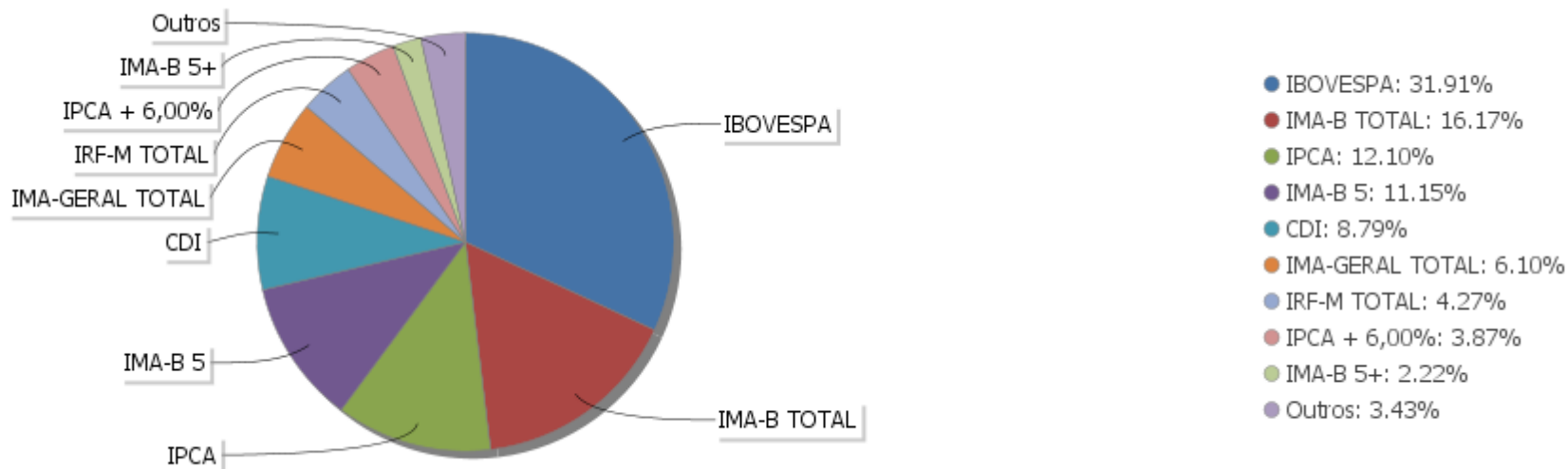
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	626.415.125,27	81,04	626.415.125,27	81,04
de 31 a 365 dias	105.205.904,89	13,61	731.621.030,16	94,65
acima de 365 dias	41.342.444,17	5,35	772.963.474,33	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

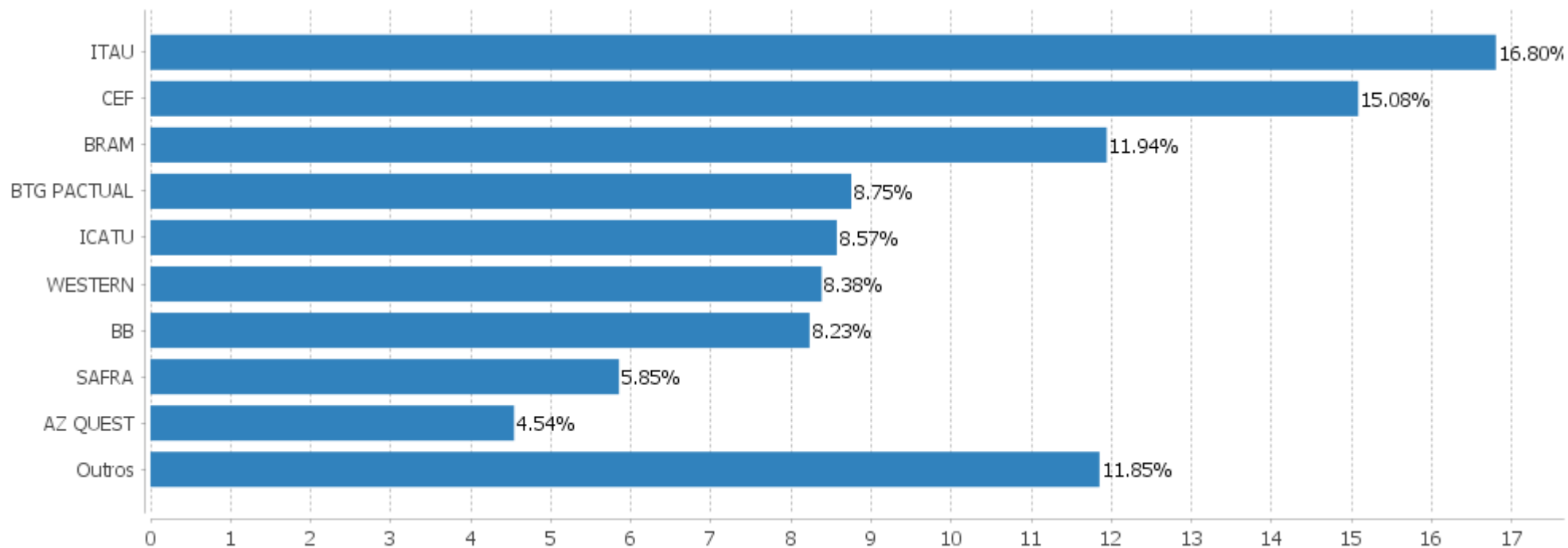


Alocação Por Estratégia



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	-0,65	4,34	3,68	5,30
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	0,16	-2,47	-11,34	3,15	2,45	2,22	2,68	-1,16	-3,19	-2,02	2,93	1,71	-6,31
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 + 6,00%	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 + 6,00%	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

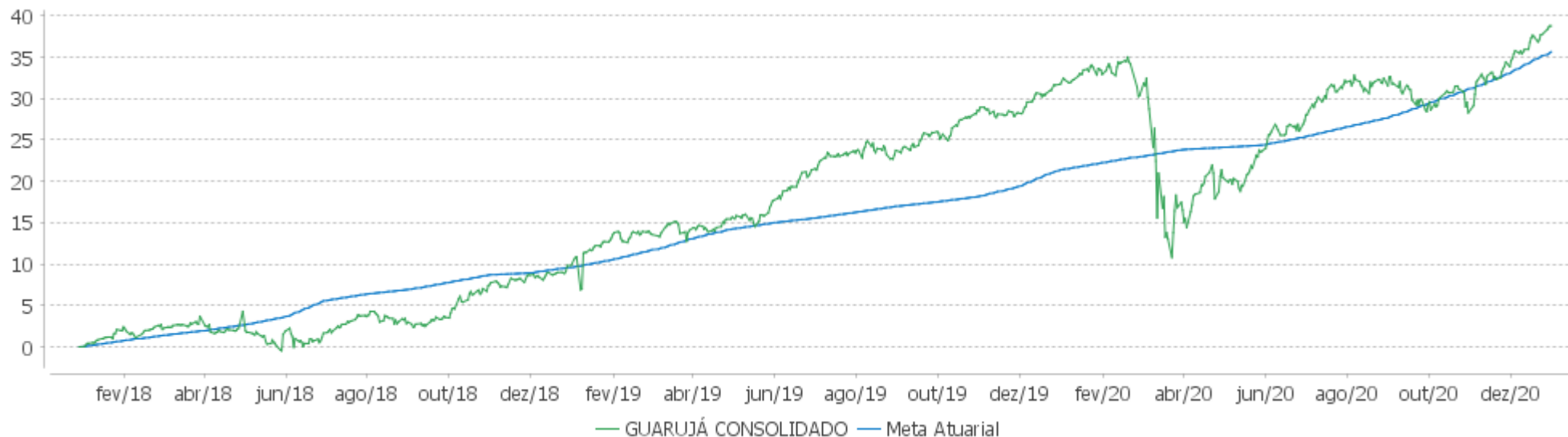
## Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	58,33	03 meses	7,48	4,82	2,66	6,84
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	41,67	06 meses	8,99	8,16	0,83	6,99
			12 meses	5,30	11,61	-6,31	14,37
			24 meses	26,36	23,64	2,72	11,29
			36 meses	38,77	35,50	3,28	9,86
Maior rentabilidade da Carteira	4,34	2020-11	Desde 29/12/2017	38,77	35,50	3,28	9,86
Menor rentabilidade da Carteira	-10,66	2020-03					

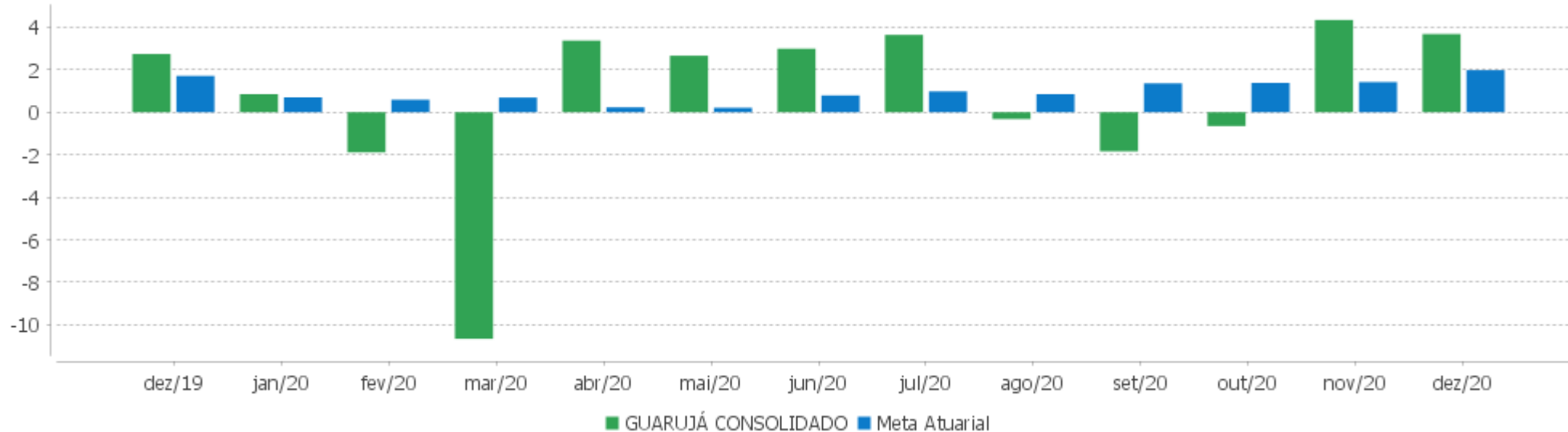


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,94 0,09	6,30 -0,10	7,16 -0,02	8,14 -0,07	6,30 -0,10	30,60 -0,23	47,40 -0,51
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,78 -0,05	7,86 -0,18	3,23 -0,15	4,48 -0,24	7,86 -0,18	21,79 -0,46	33,51 -0,80
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	4,94 3.002,88	7,53 273,00	7,12 1.509,22	7,89 800,58	7,53 273,00	33,84 381,04	50,78 319,89
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 62,57	1,64 59,56	0,22 46,14	0,39 40,05	1,64 59,56	6,54 73,64	12,17 76,68
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	2,70 1,35	6,65 2,65	3,66 0,53	3,62 -0,79			
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,29 175,96	4,11 149,05	0,78 164,32	1,20 121,29	4,11 149,05		
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	2,08 0,05	5,84 0,50	3,03 0,17	3,77 0,37	5,84 0,50	19,49 0,65	31,49 0,73
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,20 -1,15	2,86 -1,66	0,38 -2,75	0,58 -3,83	2,86 -1,66	15,12 6,10	24,58 11,47
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 54,66	1,90 68,94	0,26 54,98	0,55 56,20	1,90 68,94	7,07 79,61	13,01 81,96
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	2,37 0,54	7,60 -0,44	3,88 0,50	6,26 1,54	7,60 -0,44	20,61 -1,64	33,32 -0,99
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,88 0,02	7,96 -2,80	3,70 -0,95	5,14 -2,41	7,96 -2,80	21,14 -1,36	34,43 -0,21
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	3,24 1,41	10,18 2,15	4,43 1,05	5,13 0,41	10,18 2,15	27,76 5,51	42,78 8,47
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	1,21 -0,62	8,29 0,25	2,90 -0,48	4,76 0,04	8,29 0,25	23,53 1,28	36,58 2,27
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	7,65 -0,39	3,29 -0,09	4,47 -0,25	7,65 -0,39	21,57 -0,68	33,55 -0,76
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,21 -0,66	7,76 -3,01	2,91 -1,74	4,60 -2,95	7,76 -3,01	22,13 -0,37	43,71 9,07
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,53	7,24	7,48	7,97	7,24	32,38	51,55

## 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.	0,68	0,84	0,31	-0,24	0,84	1,55	3,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,43 -0,26	1,93 -0,06	1,62 -0,12	6,43 -0,26	18,87 -0,67	31,59 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	2,11 0,08	4,82 -0,52	2,85 -0,02	3,16 -0,25	4,82 -0,52	17,74 -1,10	29,09 -1,68
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,82 -3,03	7,48 1,07	3,38 -3,80	4,45 -3,75	7,48 1,07	22,37 -8,46	35,35 -12,56
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21 -3,65	5,61 -0,79	2,89 -4,28	3,91 -4,30	5,61 -0,79	16,66 -14,17	28,09 -19,82
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,52 0,67	9,32 2,91	8,24 1,06	8,47 0,27	9,32 2,91	34,68 3,85	53,04 5,13
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,97 0,10	8,65 -2,11	2,92 -1,72	4,45 -3,11	8,65 -2,11	25,73 3,24	39,91 5,27
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	6,66 2,15	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,53 -2,32	8,76 2,36	3,94 -3,24	4,71 -3,50	8,76 2,36	27,79 -3,04	42,87 -5,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,65 -0,08	8,03 -0,59	3,05 0,00	4,76 -0,34	8,03 -0,59	20,12 -1,34	31,29 -2,02
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,52 0,67	9,33 2,92	8,24 1,06	8,48 0,27	9,33 2,92	34,72 3,89	53,12 5,21
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,50 -0,01	5,10 -0,40	10,46 -0,07	11,23 -0,13	5,10 -0,40	36,55 -0,99	57,27 -1,45
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,83 -0,03	5,85 -0,55	7,10 -0,07	8,05 -0,16	5,85 -0,55	29,76 -1,07	46,35 -1,56
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,85 -0,45	1,23 -1,69	22,78 -3,02	24,35 -0,86	1,23 -1,69	35,86 0,44	62,79 7,01
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	9,29 -0,00	2,59 -0,33	25,72 -0,09	25,02 -0,19	2,59 -0,33	34,71 -0,71	54,99 -0,78
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do CDI	0,58 355,52	0,46 16,73	0,44 92,63	1,01 102,33	0,46 16,73	4,58 51,57	13,31 83,85
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	3,19 1.939,35	12,17 441,42	11,55 2.449,51	19,85 2.012,61	12,17 441,42	48,40 544,90	44,80 282,22
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	6,22	1,79	16,04	15,46	1,79		

## 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.	-3,08	-1,12	-9,77	-9,75	-1,12		
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO % do CDI	1,08 658,80	2,66 96,56	2,14 454,58	2,35 238,51	2,66 96,56	8,83 99,44	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	3,07 -6,23	12,58 9,67	11,36 -14,44	19,62 -5,59	12,58 9,67	48,60 13,18	44,75 -11,03
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,23 -4,06	7,88 4,96	12,39 -13,42	17,68 -7,53	7,88 4,96	50,20 14,78	81,69 25,92
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,26 -1,04	1,65 -1,27	18,79 -7,02	20,37 -4,84	1,65 -1,27	35,24 -0,18	48,92 -6,86
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	6,28 -3,01	-6,23 -9,14	18,58 -7,22	15,16 -10,05	-6,23 -9,14	41,49 6,07	73,82 18,04
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	7,97 -1,33	-21,23 -24,15	17,87 -7,94	10,19 -15,02	-21,23 -24,15	10,15 -25,27	38,81 -16,97
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,80 -0,50	5,70 2,78	25,37 -0,44	28,07 2,86	5,70 2,78	39,88 4,46	72,25 16,47
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	6,93 -0,59	-4,03 -3,38	16,98 -5,57	21,32 -4,01	-4,03 -3,38		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,93 -2,37	-3,16 -6,07	16,94 -8,86	21,44 -3,77	-3,16 -6,07	44,95 9,53	83,27 27,49
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	7,61 -1,68	-6,07 -8,99	18,87 -6,93	21,69 -3,51	-6,07 -8,99	24,85 -10,57	43,51 -12,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	6,30 -3,00	-4,87 -7,79	19,94 -5,87	22,34 -2,87	-4,87 -7,79	38,19 2,77	69,25 13,47
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,11 0,81	7,87 4,95	22,82 -2,99	24,40 -0,80	7,87 4,95	46,10 10,68	79,48 23,71
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,96 -1,33	-9,45 -12,36	20,15 -5,66	13,27 -11,93	-9,45 -12,36	29,14 -6,28	57,09 1,31
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	6,00 -3,30	-1,74 -4,65	17,11 -8,70	14,59 -10,62	-1,74 -4,65	34,20 -1,22	42,39 -13,38
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP % do CDI	1,53 928,14	-0,29 -10,47	1,30 276,60	0,89 90,22	-0,29 -10,47	14,44 162,55	13,69 86,25
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,18 -109,43	7,80 282,91	-0,57 -121,27	-1,02 -103,03	7,80 282,91	20,42 229,89	78,97 497,46
CXR11 Var. IBOVESPA p.p.	-4,50 -13,80	1,00 -1,91	-25,03 -50,84	-9,06 -34,27	1,00 -1,91	55,69 20,27	53,97 -1,81
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	0,35	44,45	1,33	16,88	44,45	98,40	

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.	-8,95	41,53	-24,48	-8,33	41,53	62,98	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,18	91,31	2,70	25,96	91,31		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,69	80,54	-1,94	18,41	80,54		
GUARUJÁ CONSOLIDADO	3,68	5,30	7,48	8,99	5,30	26,36	38,77
Var. INPC + 6,00% p.p.	1,70	-6,45	2,63	0,76	-6,45	2,57	3,11
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

## 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	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON	5,00	0,81	11,11	13,14	0,81	56,51	41,53
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
299	01/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	35.463,92	0,00	16.790,10696900	2,1121914270
310	01/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	23.093,46	0,00	10.933,41242800	2,1121914270
307	02/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.888.162,93	1.840.755,83539500	2,1122643510
320	02/12/2020	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3.336.008,11	0,00	1.648.429,20544960	2,0237497000
316	02/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.085.908,42	1.460.948,01938000	2,1122643510
325	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.235.424,89	657.116,08465300	1,8800710000
300	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	143.829,25	0,00	68.089,41114400	2,1123585530
311	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	19.487,55	0,00	9.225,49345200	2,1123585530
330	03/12/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4.231.191,68	0,00	17.759,51537400	238,2492760000
301	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.495.784,09	0,00	2.128.254,05547900	2,1124282970
312	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.554.087,87	0,00	1.682.465,56583500	2,1124282970
321	04/12/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.190,86	0,00	1.165,21037000	1,8802270000
322	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	10.500,00	0,00	5.583,52636300	1,8805320000
302	14/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	206.356,96	0,00	97.659,08454600	2,1130339380
317	14/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	206.356,96	97.659,08454600	2,1130339380
303	16/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	151.139,94	0,00	71.519,25601200	2,1132761780
328	16/12/2020	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	0,00	1.682.735,82	791.867,33278670	2,1250224000
313	16/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	19.918,80	0,00	9.425,55459900	2,1132761780
327	16/12/2020	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	0,00	1.402.762,96	660.116,78747480	2,1250224000
308	17/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.275.056,36	1.549.710,60149300	2,1133341650
318	17/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.359.370,19	1.589.606,71986400	2,1133341650
326	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10,00	5,31633800	1,8809160000
332	17/12/2020	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	4.957.813,08	0,00	470.402,57180812	10,5395110000
323	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	10,00	0,00	5,31634000	1,8809930000
329	18/12/2020	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3.359.359,74	0,00	5.936,28921800	565,9023030000
331	18/12/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.402.762,96	0,00	5.824,06825400	240,8562020000
304	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	146.982,65	0,00	69.543,28306800	2,1135420060
314	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	19.487,55	0,00	9.220,32774500	2,1135420060

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

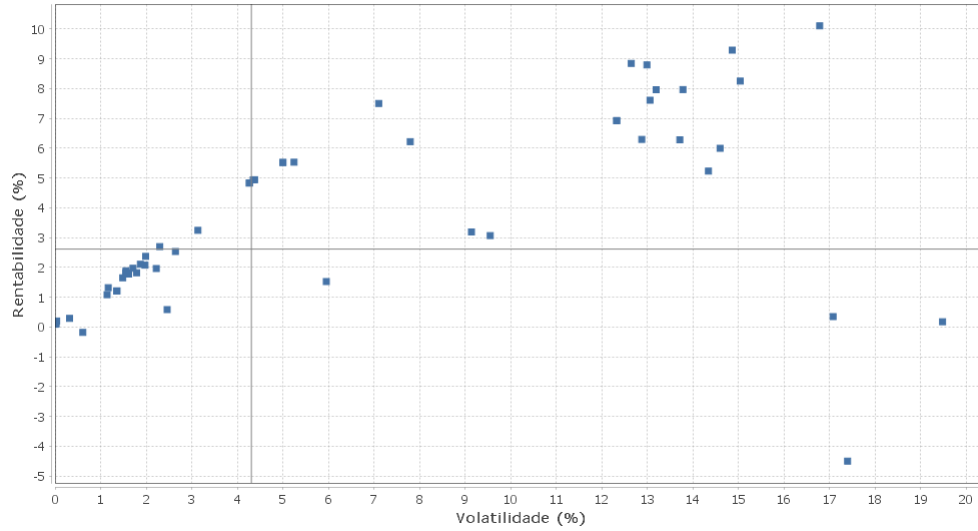
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
309	28/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.279.164,01	605.110,81512800	2,1139334780
319	28/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	198.611,71	93.953,62345500	2,1139334780
305	29/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	30.619,32	0,00	14.483,52985600	2,1140785640
306	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.239,94	0,00	2.005,48679000	2,1141699960
315	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	45.522,23	0,00	21.531,96293800	2,1141699960
324	30/12/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.095,43	0,00	582,20140900	1,8815310000
<b>Total</b>						



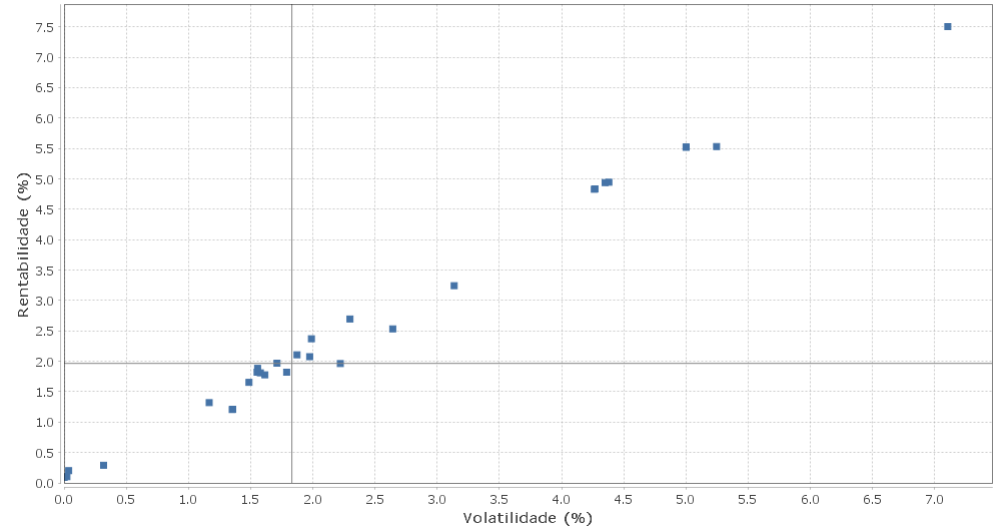
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

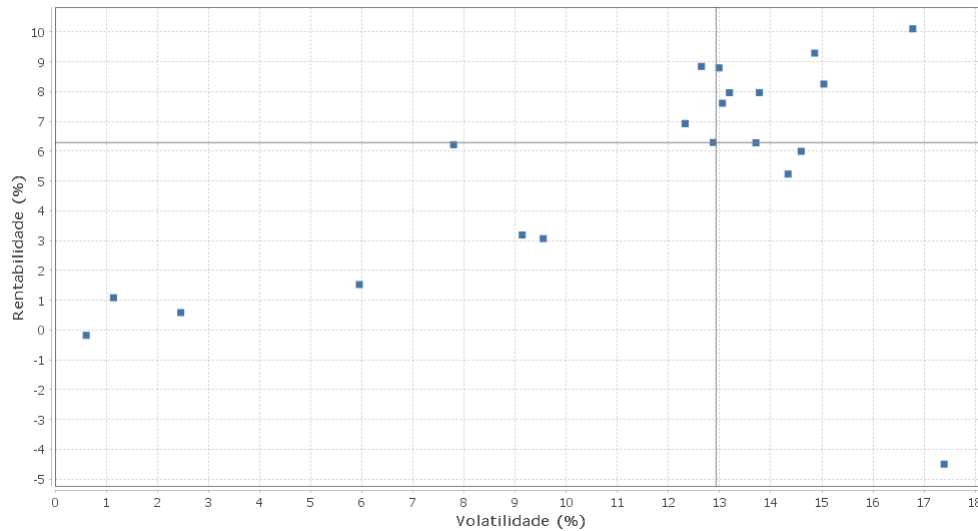
GUARUJÁ CONSOLIDADO - No Mês



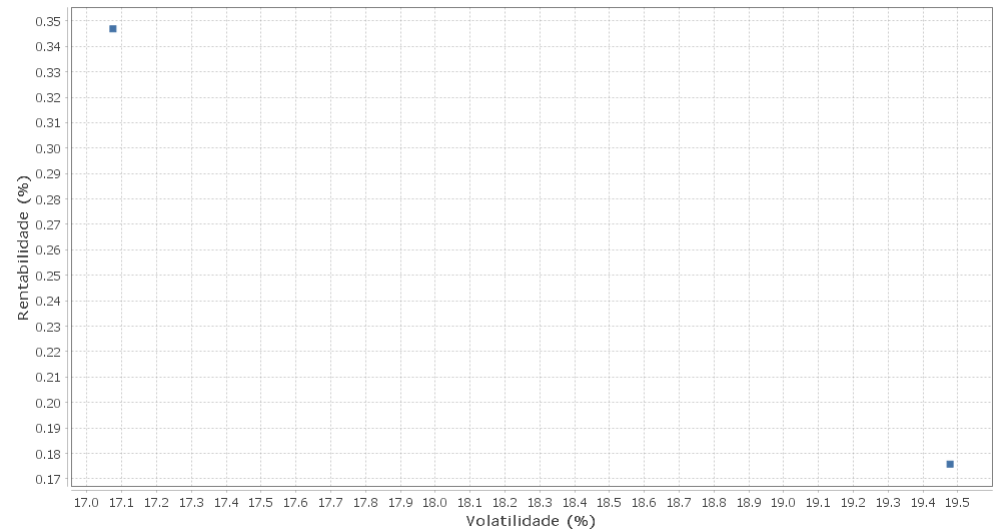
Renda Fixa - No Mês



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\$): 29.162.691,71

Value-At-Risk: 3,77%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-87,26	0,09	14.400,02	0,00
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-2,62	0,10	2.570.104,32	0,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,01	1,02	0,20	64.674.825,07	8,37
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,32	0,24	0,00	0,39	0,29	4.965.960,92	0,64
FIP LA SHOPPING CENTERS	Artigo 8º IV, Alínea a	0,61	0,04	0,00	-0,56	-0,18	5.424.830,16	0,70
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,14	NaN	0,00	0,80	1,08	0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,02	0,99	1,32	21.281.728,03	2,75
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	1,11	0,00	0,77	1,21	3.498.549,16	0,45
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	1,11	0,00	0,77	1,21	1.397.047,19	0,18
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	1,11	0,00	0,77	1,21	3.905.559,81	0,51
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,01	1,00	1,65	15.570.940,50	2,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,02	1,07	1,82	20.485.304,75	2,65
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,56	0,94	0,00	1,11	1,88	4.532.974,76	0,59
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,58	1,08	0,01	1,04	1,81	9.000.360,49	1,16
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,61	1,11	0,01	1,00	1,78	9.142.202,52	1,18
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,45	0,00	1,05	1,97	3.805.875,90	0,49
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,79	1,19	0,01	0,93	1,82	5.892.730,55	0,76
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,87	1,07	0,01	1,04	2,11	11.366.228,07	1,47
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	1,97	1,10	0,03	0,97	2,08	35.792.638,40	4,63
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	1,99	1,24	0,01	1,11	2,37	13.265.419,50	1,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,38	0,04	0,81	1,96	32.984.020,66	4,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,30	1,49	0,01	1,10	2,70	7.595.868,50	0,98
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	2,46	1,08	0,00	0,17	0,58	3.903.570,94	0,51
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,64	1,71	0,01	0,90	2,53	8.163.037,43	1,06
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,14	1,87	0,05	0,98	3,24	30.350.628,67	3,93
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,06	1,09	4,83	24.610.078,83	3,18
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,07	1,09	4,84	30.452.942,55	3,94
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,35	2,77	0,06	1,10	4,94	24.660.790,87	3,19

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,38	2,64	0,10	1,09	4,94	44.079.847,54	5,70
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,00	2,83	0,00	1,07	5,52	1.947.681,84	0,25
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,00	2,83	0,01	1,07	5,52	4.721.839,21	0,61
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	5,25	3,20	0,00	1,02	5,53	1.584.657,96	0,21
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	5,95	0,05	0,00	0,23	1,53	2.808.536,89	0,36
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,10	4,67	0,07	1,03	7,50	17.137.452,70	2,22
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	7,80	7,91	0,03	0,78	6,22	3.126.675,60	0,40
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,14	8,26	0,18	0,33	3,19	23.572.305,79	3,05
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,55	8,13	0,14	0,30	3,07	19.132.431,65	2,48
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,32	11,32	0,33	0,55	6,93	24.202.486,63	3,13
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,33	11,25	0,15	0,55	6,93	10.912.877,48	1,41
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	Artigo 8º I, Alínea a	12,64	10,15	0,11	0,69	8,85	8.872.233,67	1,15
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	12,88	10,36	0,33	0,48	6,30	25.907.944,98	3,35
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,99	10,85	0,10	0,66	8,80	7.102.872,08	0,92
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	13,06	10,31	0,02	0,57	7,61	1.503.201,55	0,19
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,19	10,14	0,28	0,59	7,96	23.733.315,65	3,07
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	13,71	9,31	0,12	0,45	6,28	10.880.702,29	1,41
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	13,78	11,63	0,14	0,57	7,97	9.659.879,20	1,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,34	10,25	0,70	0,35	5,23	56.599.996,14	7,32
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	14,60	10,19	0,10	0,40	6,00	8.203.579,65	1,06
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	14,86	10,89	0,04	0,61	9,29	3.301.730,89	0,43
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,04	10,49	0,09	0,54	8,26	6.973.444,79	0,90
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,78	11,09	0,15	0,59	10,11	10.949.851,83	1,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	17,07	11,15	0,11	0,01	0,35	24.502.275,56	3,17
CXRI11	Artigo 8º IV, Alínea b	17,39	2,71	0,00	-0,27	-4,50	2.052.750,00	0,27
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,48	12,29	0,02	0,00	0,18	20.184.284,19	2,61

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 25,44% dos recursos totais do Instituto, alocação está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos.
- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 25,44% dos recursos totais do Instituto, percentual está superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;