

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (26/02/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,58%	0,00%	0,04%	D0/D0	49.714,47	0,03%	100%	8.878.863.822,11	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	4,27%	-0,55%	-0,37%	D0/D+1	43.951.697,83	22,92%	100%	8.720.364.653,89	0,50%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	19,86%	-2,32%	-3,97%	D0/D+2	2.115.189,08	1,10%	100%	1.462.684.676,28	0,14%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	5,09%	-0,62%	-0,54%	D0/D0	32.680.670,44	17,04%	100%	13.590.487.322,92	0,24%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	4,23%	-0,53%	-0,39%	D0/D0	5.003.406,75	2,61%	100%	10.914.192.598,49	0,05%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,06%	-0,61%	-0,52%	D0/D+1	32.781.319,73	17,10%	100%	5.161.165.829,74	0,64%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,99%	-0,51%	-0,48%	D0/D0	10.576.061,36	5,52%	100%	15.107.095.289,30	0,07%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							127.158.059,67	66,31%				
AUSTRO CAPITAL	BFL Adm Rec	FI CATÂNIA RF LP	0,00%	-0,00%	-37,84%	D0/D+29	418.677,29	0,22%	20%	29.018.199,18	1,44%	15%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							418.677,29	0,22%				
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05%	0,07%	0,16%	D0/D0	12.912.653,31	6,73%	20%	550.474.030,01	2,35%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,22%	0,10%	0,26%	D0/D0	2.227,77	0,00%	20%	2.967.792.040,55	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,15%	0,05%	0,13%	D0/D0	12.478.239,14	6,51%	20%	2.459.370.188,78	0,51%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-GERAL	6,05%	-0,74%	-0,98%	D0/D+1	6.102.855,02	3,18%	20%	756.200.744,61	0,81%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							31.495.975,25	16,43%				
Sub-total Renda Fixa							159.072.712,20	82,96%				
Renda Variável												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,27%	-3,28%	-6,01%	D+1/D+1	12.012.638,62	6,26%	30%	1.143.330.805,79	1,05%	15%
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,74%	-4,38%	-7,56%	D+1/D+1	3.030.462,81	1,58%	30%	757.221.929,79	0,40%	15%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							15.043.101,43	7,85%				
CAIXA	CAIXA	CAIXA BRASIL FIC FIA AÇÕES LIVRE	42,18%	-0,01%	-3,57%	D+1/D+13	1.132.913,14	0,59%	20%	299.216.022,70	0,38%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA	47,85%	-5,23%	-9,13%	D+1/D+1	1.536.741,40	0,80%	20%	501.570.309,30	0,31%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	46,18%	-5,36%	-6,66%	D+1/D+1	1.024.264,51	0,53%	20%	631.793.991,04	0,16%	15%
BRAM	BEM DTVM	BRADESCO FIA SELECTION	44,14%	-3,24%	-5,64%	D+1/D+1	9.236.849,10	4,82%	20%	748.567.197,38	1,23%	15%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (26/02/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							12.930.768,15	6,74%				
RJI Corretora	RJI Corretora	FI MULTIMERCADO OSLO	0,00%	-0,07%	-0,15%	D+1/D0	1.123.104,50	0,59%	20%	31.092.163,10	3,61%	5%
Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado							1.123.104,50	0,59%				
INDIGO DTVM	INDIGO DTVM	CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES	0,00%	-0,03%	-0,05%	D0/D0	659.190,46	0,34%	5%	159.441.659,07	0,41%	5%
LAD CAPITAL	LAD CAPITAL	FIP CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	0,00%	-0,09%	-0,18%	D0/D0	1.392.045,49	0,73%	5%	99.401.017,60	1,40%	5%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - FI em Participações							2.051.235,95	1,07%				
TMJ CAPITAL	RJI Corretora	HAZ FII	2,26%	0,09%	-0,37%	D0/D0	1.528.227,06	0,80%	5%	71.827.616,84	2,13%	5%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários							1.528.227,06	0,80%				
Sub-total Renda Variável							32.676.437,10	17,04%				
Total							191.749.149,30	100%				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira						
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/2010	Margem
Renda Fixa						
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	127.158.059,67	66,31%	46,00%	100,00%	-38.953.450,99
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	418.677,29	0,22%	1,00%	60,00%	1.498.814,21
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	31.495.975,25	16,43%	4,00%	40,00%	-23.826.009,28
Total Renda Fixa		159.072.712,20	82,96%			
Renda Variável						
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	15.043.101,43	7,85%	5,00%	30,00%	-5.455.643,97
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	12.930.768,15	6,74%	18,00%	20,00%	21.584.078,73
Artigo 8º III	FI Multimercado	1.123.104,50	0,59%	1,00%	10,00%	794.386,99
Artigo 8º IV, Alínea a	FI em Participações	2.051.235,95	1,07%	1,00%	5,00%	-133.744,46
Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.528.227,06	0,80%	2,00%	5,00%	2.306.755,92
Total Renda Variável		32.676.437,10	17,05%			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

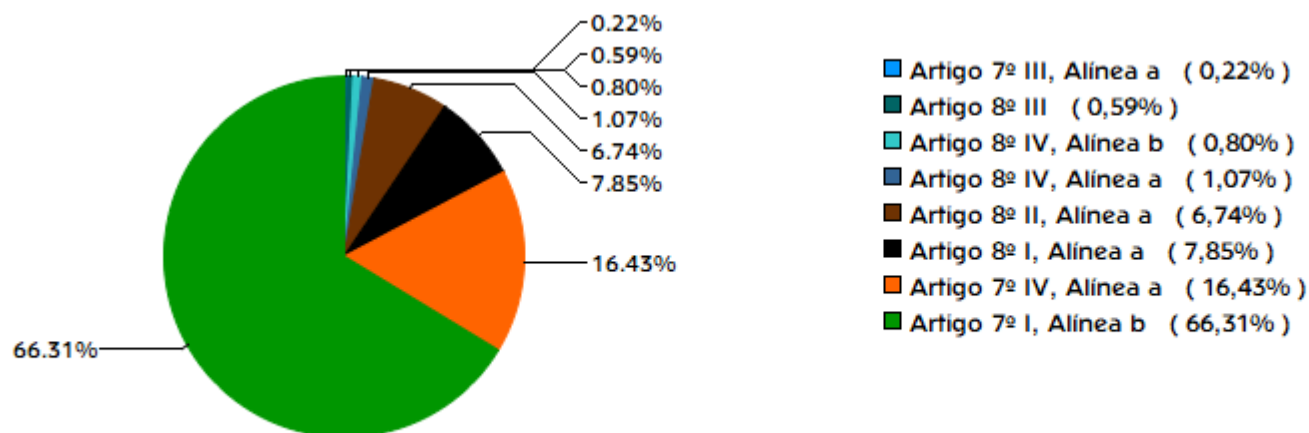
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,61 -452,8	-0,52 -184,4	3,72 157,1	16,59 205,1
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,00 0,0	-37,84 -13.315,0	-48,04 -2.025,6	-52,09 -644,1
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,09 -68,4	-0,08 -29,2	1,68 70,6	6,56 81,2
Artigo 8º I, Alínea a % do CDI	-3,50 -2.605,1	-6,32 -2.225,1	5,60 236,2	18,22 225,3
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-3,38 -2.513,3	-5,98 -2.102,8	5,01 211,1	-- --
Artigo 8º III % do CDI	-0,07 -51,8	-0,15 -52,4	-10,46 -441,0	-12,94 -160,0
Artigo 8º IV, Alínea a % do CDI	-0,07 -49,1	-0,14 -49,0	-37,38 -1.576,4	-37,99 -469,8

Ganhos Financeiros

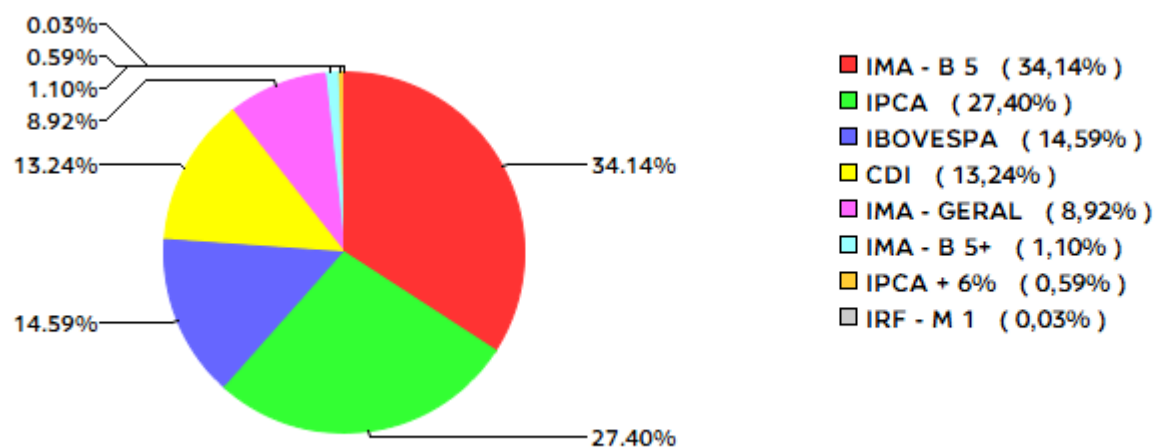
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-779.372,21
Artigo 7º III, Alínea a	-0,00
Artigo 7º IV, Alínea a	-30.808,37
Artigo 8º I, Alínea a	-546.350,39
Artigo 8º II, Alínea a	-452.500,21
Artigo 8º III	-782,92
Artigo 8º IV, Alínea a	-1.355,54
Artigo 8º IV, Alínea b	1.406,28
Total	-1.809.763,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

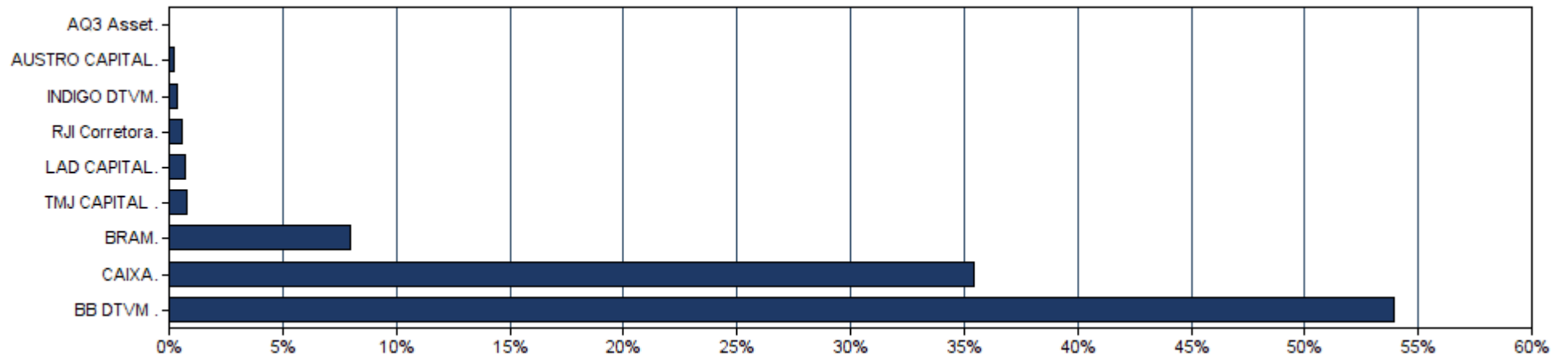


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

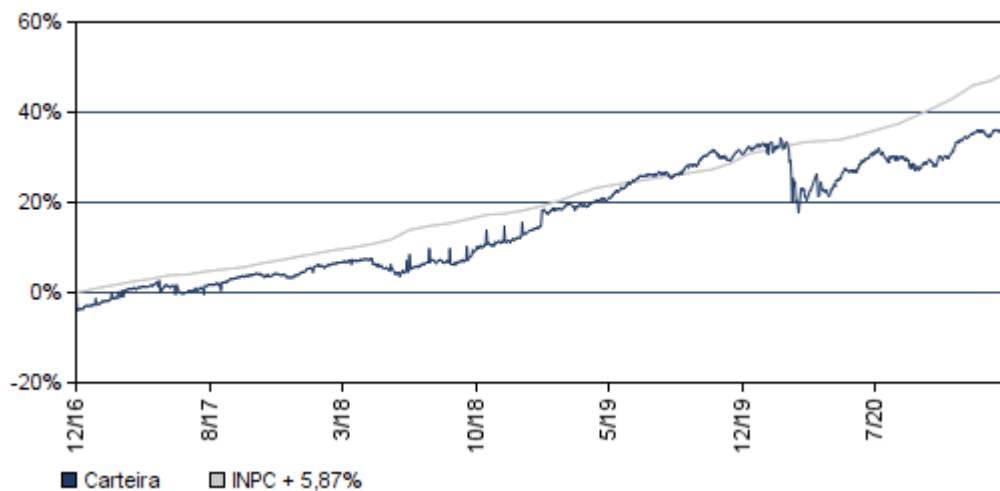


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

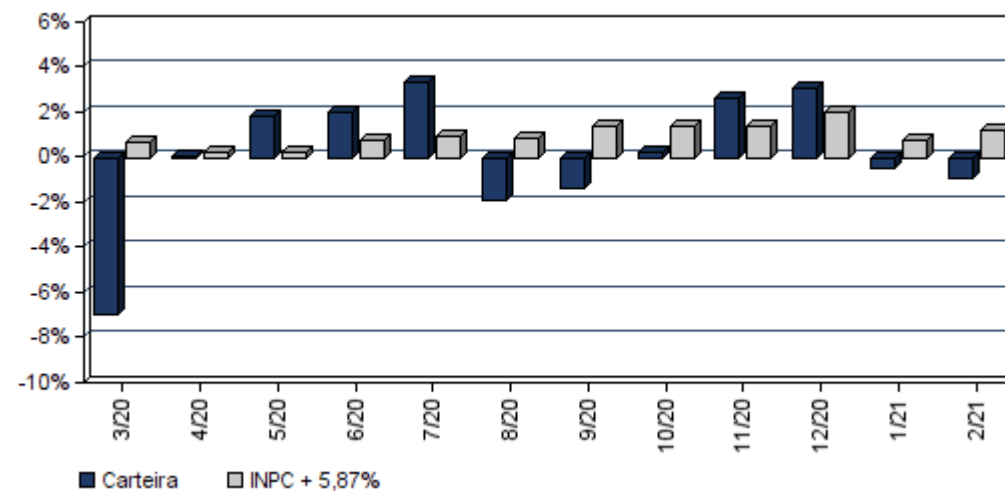
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	1,91	0,37	0,78	0,22	-1,32	2,14	1,54	-0,15	0,37	3,29	0,60	0,87	11,07
INPC + 5,87%	0,73	0,59	0,55	0,69	0,91	1,91	0,75	0,52	0,73	0,90	0,20	0,59	9,46
p.p. Indx	1,18	-0,22	0,23	-0,46	-2,23	0,22	0,79	-0,67	-0,36	2,39	0,39	0,27	1,61
2019	2,28	0,34	0,46	1,00	1,67	1,95	1,04	-0,14	1,99	2,32	-1,39	2,12	14,45
INPC + 5,87%	0,86	1,00	1,20	1,08	0,65	0,44	0,62	0,43	0,43	0,56	1,00	1,70	10,64
p.p. Indx	1,42	-0,65	-0,75	-0,08	1,02	1,51	0,42	-0,76	1,57	1,76	-2,39	0,42	3,81
2020	-1,10	0,99	-7,00	0,07	1,82	2,00	3,32	-1,90	-1,35	0,23	2,61	3,05	2,31
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. Indx	-1,79	0,41	-7,68	-0,15	1,62	1,22	2,36	-2,74	-2,70	-1,14	1,20	1,08	-9,30
2021	-0,52	-0,93	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-1,44
INPC + 5,87%	0,72	1,23	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,97
p.p. Indx	-1,24	-2,16	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-3,41

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	INPC + 5,87%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	20	52,6%					
Meses abaixo do Benchmark	18	47,4%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,32%	jul/20	03 meses	1,57	3,97	-2,4	4,579
Menor rentabilidade da Carteira	-7,00%	mar/20	06 meses	3,05	8,32	-5,3	5,291
			12 meses	0,95	12,37	-11,4	11,221
			24 meses	12,45	23,61	-11,2	8,495
			36 meses	25,31	36,02	-10,7	9,822
			Desde o início	33,30	48,83	-15,5	9,208

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,00 -0,04	0,04 -0,05	0,35 -0,04	0,70 -0,23	2,71 -0,37	9,12 -0,68	16,38 -0,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 Var. do IPCA p.p.	-0,55 -1,41	-0,37 -1,48	1,15 -1,33	2,96 -1,99	6,43 1,24	17,41 8,00	28,62 14,95
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	-2,32 0,01	-3,97 0,00	3,20 -0,03	3,19 -0,19	0,54 -0,41	22,54 -0,67	43,21 -1,21
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	1,27 -0,06	2,60 -0,15	5,92 -0,31	18,50 -0,66	30,23 -0,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	-0,53 -1,39	-0,39 -1,51	1,25 -1,22	2,68 -2,27	6,48 1,28	17,50 8,09	28,81 15,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,61 -0,02	-0,52 -0,03	1,28 -0,05	2,64 -0,10	5,94 -0,29	18,61 -0,55	30,33 -0,86
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,51 0,18	-0,48 0,45	0,83 -0,24	1,04 -0,26	4,64 1,33	6,13 1,59	6,13 1,59
FI CATÂNIA RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,00 0,69	-37,84 -36,91	-37,94 -39,01	-38,24 -39,54	-48,04 -51,34	-52,09 -67,06	-64,11 -90,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,07 55,14	0,16 54,98	0,25 54,84	0,50 54,98	1,52 64,03	2,29 68,44	2,29 68,44
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,10 70,86	0,26 91,70	0,51 114,20	0,86 93,55	2,03 85,59	7,47 92,34	14,25 94,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI % do CDI	0,05 35,54	0,13 44,47	0,23 51,08	0,34 37,58	1,26 53,22	5,77 71,34	11,34 75,52
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-GERAL Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,74 -0,05	-0,98 -0,05	1,07 0,00	1,50 0,20	1,71 0,23	1,71 0,23	1,71 0,23
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. do IBOVESPA p.p.	-3,28 1,09	-6,01 1,54	2,21 1,17	11,03 0,29	5,37 -0,26	18,71 3,60	47,16 7,70
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-4,38 -0,01	-7,56 -0,01	0,99 -0,06	10,58 -0,16	5,34 -0,29	1,02 -0,14	1,02 -0,14
CAIXA BRASIL FIC FIA AÇÕES LIVRE Var. do IBOVESPA p.p.	-0,01 4,36	-3,57 3,97	2,68 1,63	12,81 2,08	4,71 -0,92	13,29 11,75	13,29 11,75
CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA Var. do IBOVESPA p.p.	-5,23 -0,85	-9,13 -1,58	-1,56 -2,61	4,20 -6,53	-0,53 -6,15	2,45 0,90	2,45 0,90
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO Var. do IBOVESPA p.p.	-5,36 -0,99	-6,66 0,88	-2,10 -3,15	-1,00 -11,74	-0,20 -5,83	2,43 1,27	2,43 1,27
BRADESCO FIA SELECTION Var. do IBOVESPA p.p.	-3,24 1,13	-5,64 1,90	1,81 0,77	10,71 -0,02	12,64 2,16	12,64 2,16	12,64 2,16
FI MULTIMERCADO OSLO Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,07 -1,35	-0,15 -2,15	-0,24 -4,15	-0,80 -8,75	-49,23 -60,66	-54,16 -76,97	-55,35 -90,60
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES Var. do IPCA p.p.	-0,03 -0,89	-0,05 -1,17	-0,08 -2,56	-0,58 -5,53	-0,76 -5,95	-0,74 -10,15	-1,14 -14,80
FIP CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA Var. do IPCA p.p.	-0,09 -0,95	-0,18 -1,29	-0,18 -2,66	-0,61 -5,55	-46,70 -51,89	-47,35 -56,75	-- 0,00
HAZ FII Var. do IPCA p.p.	0,09 -0,77	-0,37 -1,48	-0,23 -2,70	-0,40 -5,35	1,91 -3,28	2,05 -7,36	19,39 5,72
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,37	8,09	15,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IMA - B	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA - B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA - B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA - GERAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IRF - M	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IRF - M 1	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF - M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,90
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IPCA + 6%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25
INPC + 5,87%	1,23	1,97	3,97	8,32	12,37	23,61	36,02
INPC + 6%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
Dolar Comercial	0,99	6,42	3,72	1,08	22,93	47,93	70,43
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Análise dos Fundos & Ativos da Carteira**

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
IGPM	2,53	5,18	6,18	18,12	28,94	37,75	48,24
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66