

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (29/01/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTIT RENDA FIXA IRFM-1 FI	0,57%	0,06%	0,06%	D0/D0	0,00	0,00%	100%	237.534.424,76	0,00%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INST RF IMA-B 5 FIC FI	5,04%	0,08%	0,08%	D0/D0	23.276.873,97	9,82%	100%	1.538.309.557,84	1,51%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B FIC FI	12,79%	-0,88%	-0,88%	D0/D+1	41.090.807,76	17,33%	100%	403.585.829,78	10,18%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	12,85%	-0,86%	-0,86%	D0/D+1	16.363.854,02	6,90%	100%	8.335.200.025,45	0,20%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	12,90%	-0,87%	-0,87%	D0/D0	34.173.454,98	14,41%	100%	6.185.705.380,20	0,55%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,56%	0,03%	0,03%	D0/D0	0,00	0,00%	100%	10.435.150.283,00	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	5,06%	0,08%	0,08%	D0/D0	16.898.342,83	7,13%	100%	13.518.203.391,91	0,13%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,04%	0,10%	0,10%	D0/D+1	20.413.088,25	8,61%	100%	5.043.806.710,80	0,40%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2	5,84%	-0,84%	-0,84%	D0/D0	0,00	0,00%	100%	606.033.486,21	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98%	0,03%	0,03%	D0/D0	25.985.748,65	10,96%	100%	14.822.912.413,17	0,18%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							178.202.170,46	75,16%				
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	6,98%	-0,58%	-0,58%	D0/D0	7.988.914,96	3,37%	20%	1.406.368.486,30	0,57%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	14,66%	0,40%	0,40%	D0/D0	6.892.572,88	2,91%	20%	641.898.631,43	1,07%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI	0,20%	0,17%	0,17%	D0/D0	3.001.575,90	1,27%	20%	19.956.791.600,04	0,02%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,44%	-0,02%	-0,02%	D0/D+1	18.065.176,65	7,62%	20%	1.002.679.832,30	1,80%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	1,67%	0,13%	0,13%	D0/D0	0,00	0,00%	20%	3.621.561.522,63	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							35.948.240,40	15,16%				
PETRA CAPITAL	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	11,23%	-0,20%	-0,20%	D0/D0	3.962.314,20	1,67%	5%	81.485.429,48	4,86%	5%
BRPP Gestão Prod Estrut	GERAÇÃO FUTURO Corret	FIDC MULTISSETORIAL MASTER III SEN	0,00%	9,82%	9,82%	D0/D0	27.004,43	0,01%	5%	2.254.638,19	1,20%	5%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							3.989.318,62	1,68%				
MACROINVEST Gest Rec	INDIGO DTVM	SANTOS CREDIT YIELD FI RF CRED PRIV	18,96%	-1,41%	-1,41%	D0/D0	258.096,32	0,11%	5%	46.099.144,96	0,56%	5%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"							258.096,32	0,11%				
Sub-total Renda Fixa							218.397.825,80	92,11%				
Renda Variável												

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (29/01/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
BRAM	BEM DTVM	BRABESCO FIA SELECTION	44,62%	-2,48%	-2,48%	D+1/D+1	5.126.785,04	2,16%	20%	781.607.838,45	0,66%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	44,50%	-1,46%	-1,46%	D0/D+21	5.582.612,37	2,35%	20%	3.479.599.111,95	0,16%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							10.709.397,41	4,52%				
BRAM	Banco BRADESCO	BRABESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	4,80%	-0,04%	-0,04%	D0/D0	7.997.100,44	3,37%	20%	292.097.101,63	2,74%	5%
Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado							7.997.100,44	3,37%				
Sub-total Renda Variável							18.706.497,85	7,89%				
Total							237.104.323,65	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	178.202.170,46	75,16%	56,66%	100,00%	-43.858.860,68
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	35.948.240,40	15,16%	19,44%	40,00%	10.144.840,12
Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	3.989.318,62	1,68%	1,76%	5,00%	183.717,47
Artigo 7º VII, Alínea b	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	258.096,32	0,11%	0,62%	5,00%	1.211.950,49
Total Renda Fixa		218.397.825,80	92,11%			
Renda Variável						
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	10.709.397,41	4,52%	18,45%	20,00%	33.036.350,31
Artigo 8º III	FI Multimercado	7.997.100,44	3,37%	3,07%	10,00%	-717.997,71
Total Renda Variável		18.706.497,85	7,89%			

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

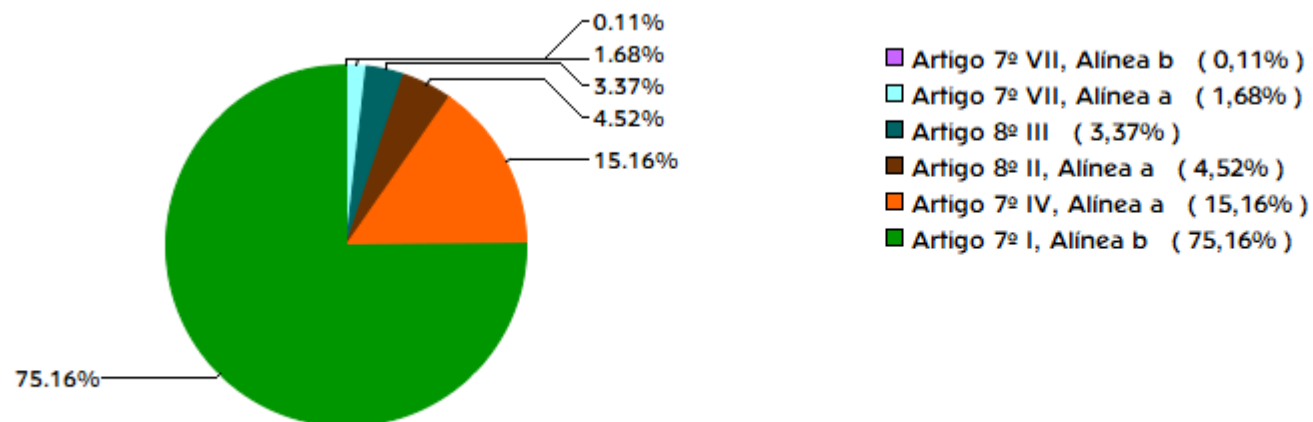
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,42 -277,8	-0,42 -277,8	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,01 -8,8	-0,01 -8,8	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,14 -95,5	-0,14 -95,5	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-1,41 -942,5	-1,41 -942,5	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-1,95 -1.306,7	-1,95 -1.306,7	-- --	-- --
Artigo 8º III % do CDI	-0,04 -485,3	-0,04 -485,3	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

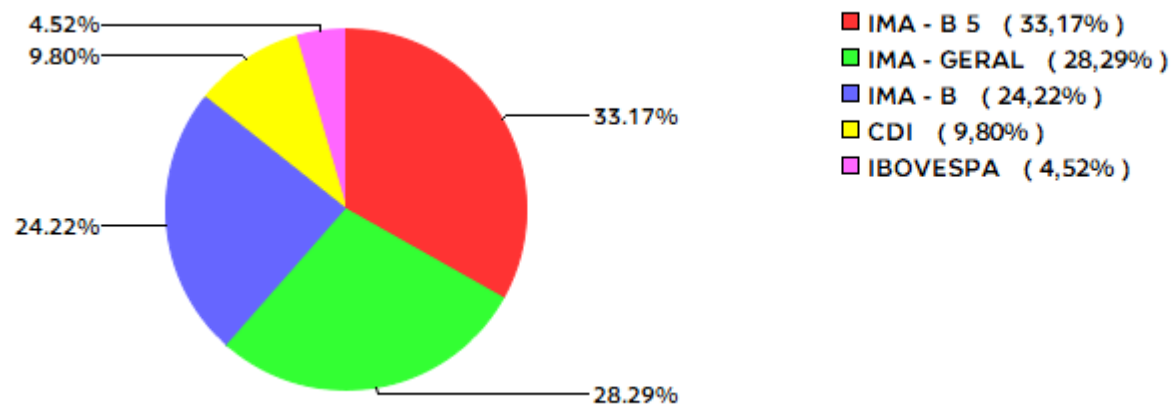
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-947.633,73
Artigo 7º IV, Alínea a	-9.446,93
Artigo 7º VII, Alínea a	-5.703,54
Artigo 7º VII, Alínea b	-3.688,18
Artigo 8º II, Alínea a	-213.350,95
Artigo 8º III	-2.899,56
Total	-1.182.722,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

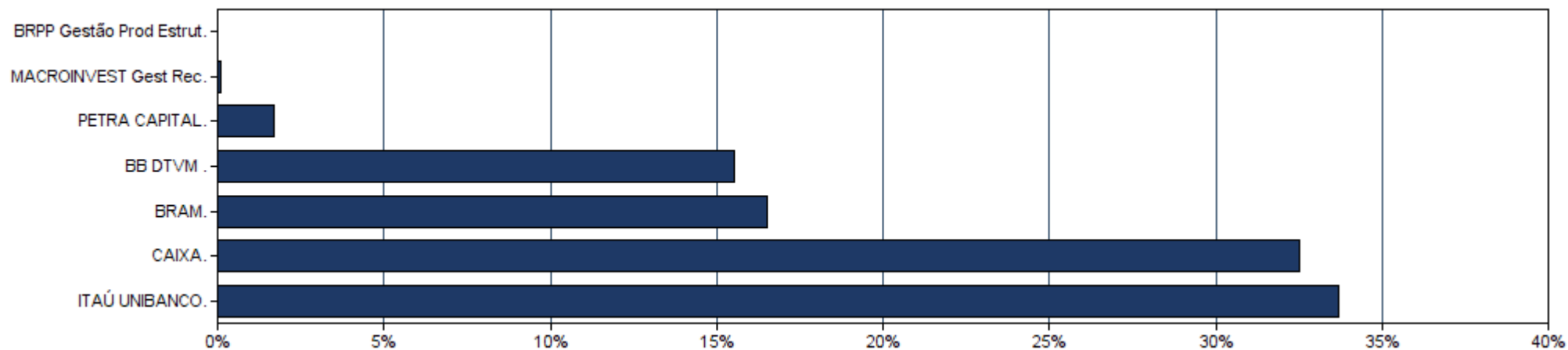


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

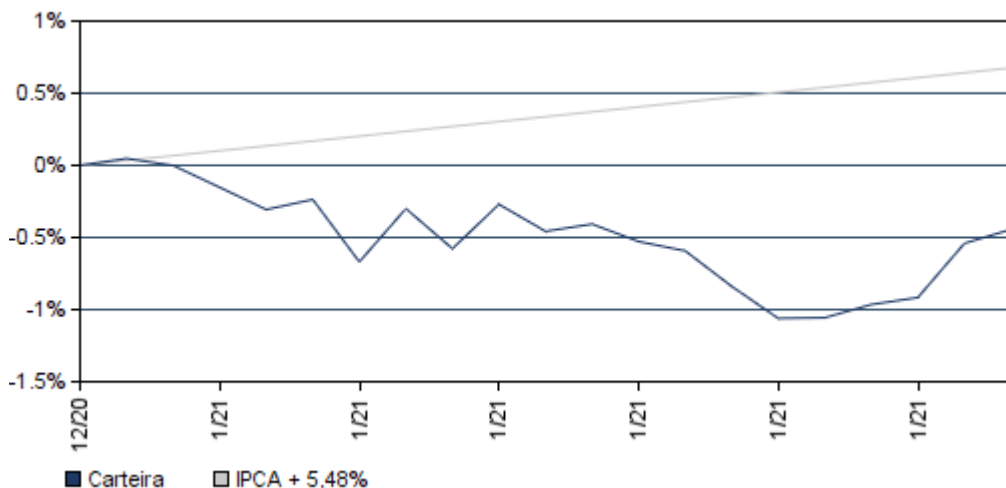


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

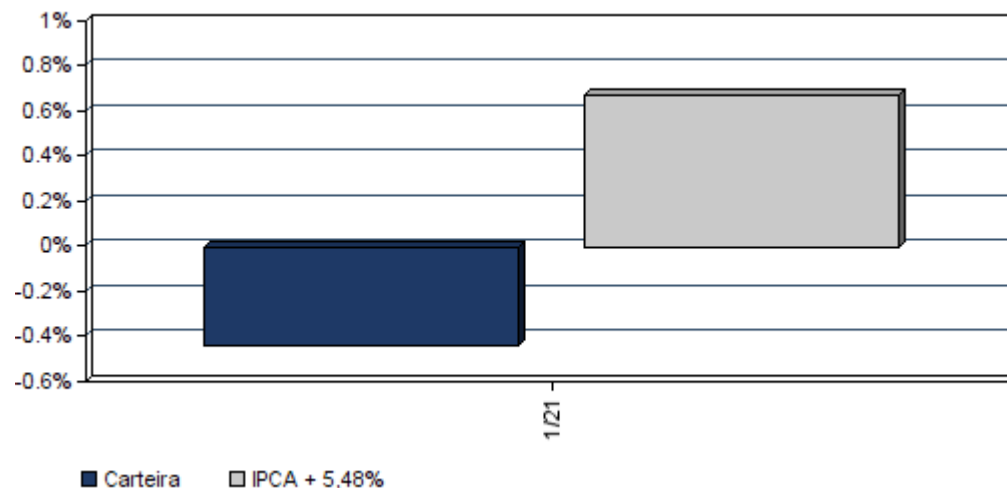
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2021	-0,44	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,44
IPCA + 5,48%	0,68	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,68
p.p. Indx	-1,12	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-1,12

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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
BRADESCO FI RENDA FIXA IDKA PRE 2 Var. do IPCA p.p.	-0,84 -1,09	-0,84 -1,09	-0,84 -1,09	-0,84 -1,09	-0,84 -1,09	-0,84 -1,09	-0,84 -1,09
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,03 0,27	0,03 0,27	0,03 0,27	0,03 0,27	0,03 0,27	0,03 0,27	0,03 0,27
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA % do CDI	-0,58 -387,51	-0,58 -387,51	-0,58 -387,51	-0,58 -387,51	-0,58 -387,51	-0,58 -387,51	-0,58 -387,51
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,40 0,01	0,40 0,01	0,40 0,01	0,40 0,01	0,40 0,01	0,40 0,01	0,40 0,01
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI % do CDI	0,17 110,92	0,17 110,92	0,17 110,92	0,17 110,92	0,17 110,92	0,17 110,92	0,17 110,92
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,13 0,38	0,13 0,38	0,13 0,38	0,13 0,38	0,13 0,38	0,13 0,38	0,13 0,38
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR % do CDI	-0,20 -136,80	-0,20 -136,80	-0,20 -136,80	-0,20 -136,80	-0,20 -136,80	-0,20 -136,80	-0,20 -136,80
FIDC MULTISSETORIAL MASTER III SEN % do CDI	9,82 6.572,45	9,82 6.572,45	9,82 6.572,45	9,82 6.572,45	9,82 6.572,45	9,82 6.572,45	9,82 6.572,45
SANTOS CREDIT YIELD FI RF CRED PRIV % do CDI	-1,41 -942,47	-1,41 -942,47	-1,41 -942,47	-1,41 -942,47	-1,41 -942,47	-1,41 -942,47	-1,41 -942,47
BRADESCO FIA SELECTION Var. do IBOVESPA p.p.	-2,48 0,84	-2,48 0,84	-2,48 0,84	-2,48 0,84	-2,48 0,84	-2,48 0,84	-2,48 0,84
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI Var. do IBOVESPA p.p.	-1,46 1,85	-1,46 1,85	-1,46 1,85	-1,46 1,85	-1,46 1,85	-1,46 1,85	-1,46 1,85
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO % do CDI	-0,04 -485,26	-0,04 -485,26	-0,04 -485,26	-0,04 -485,26	-0,04 -485,26	-0,04 -485,26	-0,04 -485,26
IPCA + 5,48%	0,68	0,68	3,86	7,10	10,22	21,16	32,57
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,54	8,47	15,40

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	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA - B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA - B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA - GERAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IRF - M	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IRF - M 1	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF - M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,02
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IPCA + 6%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53
INPC + 6%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
Dolar Comercial	5,37	5,37	-5,13	5,24	28,26	49,95	73,16
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39

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
<i>IGPM</i>	2,58	2,58	6,96	18,37	25,71	35,53	44,68
<i>INPC</i>	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
<i>IPCA</i>	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06