



LDB
EMPRESAS

CAMPINAS CONSOLIDADO
JANEIRO 2021



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.01.2021.

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

67,59%

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
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	62.392.404,00	7,05	8.335.200.025,45	0,75
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,85	-0,89	-0,89	66.431.679,42	7,51	735.043.145,99	9,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	1.518.401,87	0,17	10.435.150.283,00	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	83.968.440,13	9,49	13.518.203.391,91	0,62
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-1,70	-1,70	41.604.801,63	4,70	1.607.704.843,41	2,59
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,09	0,08	0,08	25.008.002,60	2,83	1.322.067.161,73	1,89
BB	BB	BB PREV RF VII	2,45	0,29	0,29	1.987.128,95	0,22	246.568.875,27	0,81
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	57.437.247,98	6,49	9.495.985.226,13	0,60
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,40	0,29	0,29	14.010.736,36	1,58	471.644.372,24	2,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,47	1,33	1,33	15.065.690,00	1,70	87.489.905,60	17,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,20	-0,50	-0,50	369.424.532,94	41,75		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	6,36	-0,02	-0,02	10.629.081,45	1,20	665.588.130,39	1,60
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			6,36	-0,02	-0,02	10.629.081,45	1,20		

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
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,22	0,17	0,17	69.642.140,13	7,87	2.962.335.860,83	2,35
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	15,58	-1,11	-1,11	31.888.024,82	3,60	778.748.176,57	4,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,44	-0,02	-0,02	64.044.287,40	7,24	1.002.679.832,30	6,39
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	27.080.637,73	3,06	3.621.561.522,63	0,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,43	-0,05	-0,05	192.655.090,08	21,78		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	GENIAL	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	123,95	56,16	56,16	21.615,87	0,00	2.254.638,19	0,96
VOTORANTIM	VOTORANTIM	FIDC SANASA	9,82	1,84	1,84	4.233.459,96	0,48	143.015.219,97	2,96
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	241,50	0,07	0,07	407.269,85	0,05	55.722.518,28	0,73
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			10,57	1,91	1,91	4.662.345,68	0,53		

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	4,57	0,10	0,10	2.382.778,59	0,27	627.044.892,55	0,38
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	6,14	0,35	0,35	14.013.112,46	1,58	833.854.391,71	1,68
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,60	0,25	0,25	3.977.793,91	0,45	146.206.802,32	2,72
QUELUZ	BNY MELLON	URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV	60,39	-2,13	-2,13	279.103,30	0,03	1.883.855,73	14,82
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,43	0,27	0,27	20.652.788,26	2,33		
Renda Fixa			6,18	-0,28	-0,28	598.023.838,41	67,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,14%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESA	45,03	-3,32	-3,32	37.305.713,05	4,22	761.516.224,91	4,90
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,03	-3,32	-3,32	37.305.713,05	4,22		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	44,62	-2,48	-2,48	21.762.880,85	2,46	781.607.838,45	2,78
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,50	-3,92	-3,92	30.404.391,81	3,44	1.645.559.797,71	1,85
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,73	-1,91	-1,91	11.667.544,83	1,32	1.364.096.457,43	0,86
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,58	-0,62	-0,62	25.346.307,07	2,86	2.721.146.302,78	0,93
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	45,26	-1,88	-1,88	32.846.801,23	3,71	983.619.225,02	3,34
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	45,12	-4,25	-4,25	15.791.679,44	1,78	1.124.223.357,95	1,40
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,54	-5,59	-5,59	10.855.103,24	1,23	1.137.598.937,97	0,95
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	47,01	-1,91	-1,91	9.201.342,15	1,04	546.614.791,16	1,68
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,36	-2,01	-2,01	6.039.546,26	0,68	57.464.401,48	10,51
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	49,52	-0,12	-0,12	10.845.707,06	1,23	1.200.110.828,77	0,90
RIO VERDE	BEM	RIO VERDE SMALL CAPS FIA	48,83	-3,21	-3,21	5.720.577,14	0,65	55.554.983,83	10,30
TPE	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	36,35	-3,44	-3,44	18.697.741,64	2,11	301.451.728,43	6,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,63	-2,60	-2,60	199.179.622,72	22,51		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT	2,72	-0,04	-0,04	4.308.295,00	0,49	177.357.567,77	2,43
MAUA	BTG PACTUAL	MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	4,88	-0,83	-0,83	6.331.837,23	0,72	208.047.337,14	3,04
XP	BNY MELLON	XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	6,19	-0,85	-0,85	4.729.354,31	0,53	449.817.766,92	1,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 8º III			4,11	-0,62	-0,62	15.369.486,54	1,74		
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
RJI	RJI	FIP LSH - MULTISTRATÉGIA	0,15	-0,04	-0,04	3.933.874,56	0,44	110.269.665,43	3,57
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			0,15	-0,04	-0,04	3.933.874,56	0,44		
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	VOTORANTIM	RBRD11	64,16	-6,56	-6,56	1.988.377,27	0,22	147.686.865,84	1,35
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			64,16	-6,56	-6,56	1.988.377,27	0,22		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			38,81	-2,59	-2,59	257.777.074,14	29,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,27%

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	30,10	4,30	4,30	17.876.509,41	2,02	1.477.834.874,26	1,21
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,67	6,27	6,27	11.073.179,29	1,25	82.428.056,04	13,43
Sub-total Artigo 9º A, II			30,14	5,04	5,04	28.949.688,70	3,27		
Investimentos no Exterior			30,14	5,04	5,04	28.949.688,70	3,27		
Total			11,92	-0,81	-0,81	884.750.601,25	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	369.424.532,94	41,75	30,00	51,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	10.629.081,45	1,20	0,00	0,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	192.655.090,08	21,78	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	4.662.345,68	0,53	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	20.652.788,26	2,33	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	598.023.838,41	67,59				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	37.305.713,05	4,22	0,00	4,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	199.179.622,72	22,51	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.369.486,54	1,74	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.933.874,56	0,44	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.988.377,27	0,22	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	257.777.074,14	29,14				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	28.949.688,70	3,27	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	28.949.688,70	3,27				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

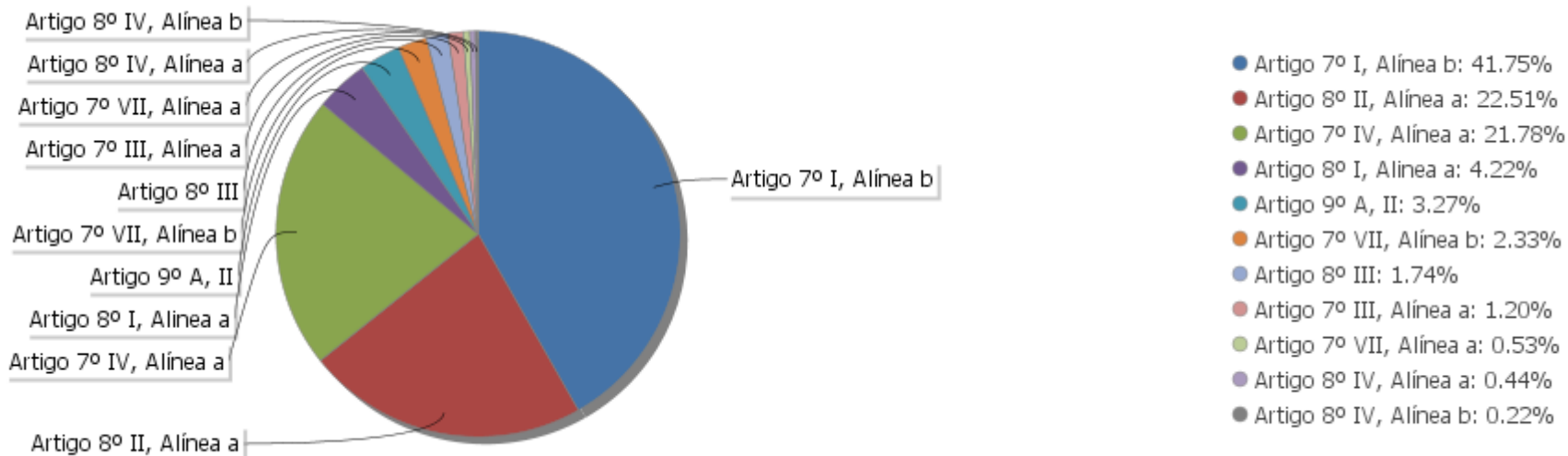
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,50 -331,52	-0,50 -331,52	4,61 993,03	3,07 325,86	5,87 232,50	-1.839.928,50	-1.839.928,50
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,02 -15,22	-0,02 -15,22	4,19 902,97	4,07 432,07		-2.419,49	-2.419,49
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,05 -30,89	-0,05 -30,89	1,59 341,91	1,45 153,94	2,86 113,20	-158.467,49	-158.467,49
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	1,91 1.275,56	1,91 1.275,56	5,43 1.170,95	19,14 2.033,91	25,72 1.018,35	91.988,09	91.988,09
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,27 177,28	0,27 177,28	3,36 724,91	4,65 494,14	5,29 209,53	54.587,23	54.587,23
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,32 -0,00	-3,32 -0,00	22,26 -0,21	11,68 -0,13	1,02 -0,13	-1.281.250,63	-1.281.250,63
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,60 0,72	-2,60 0,72	17,80 -4,67	8,84 -2,97	-3,31 -4,46	-5.323.132,31	-5.323.132,31
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,62 2,70	-0,62 2,70	2,15 -20,32	0,14 -11,68	1,01 -0,14	-95.571,79	-95.571,79
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,04 3,27	-0,04 3,27	-0,13 -22,61	-0,26 -12,07	-0,53 -1,67	-1.740,77	-1.740,77
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-6,56 -3,24	-6,56 -3,24	9,13 -13,34	-7,25 -19,06	-12,16 -13,31	-139.491,32	-139.491,32
Artigo 9º A, II % do CDI	5,04 3.374,65	5,04 3.374,65	9,26 1.995,54	28,37 3.015,20		1.390.311,94	1.390.311,94
CAMPINAS CONSOLIDADO (Total)						-7.305.115,04	-7.305.115,04

Análise de Liquidez

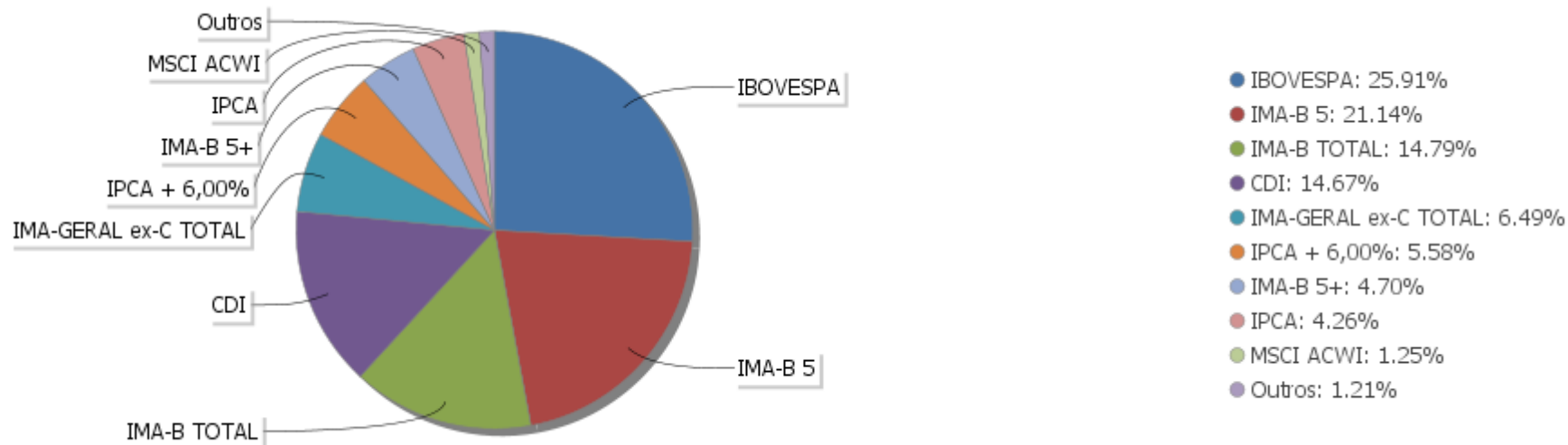
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	749.211.719,02	84,68	749.211.719,02	84,68
de 31 a 365 dias	101.406.175,18	11,46	850.617.894,20	96,14
acima de 365 dias	34.132.707,05	3,86	884.750.601,25	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

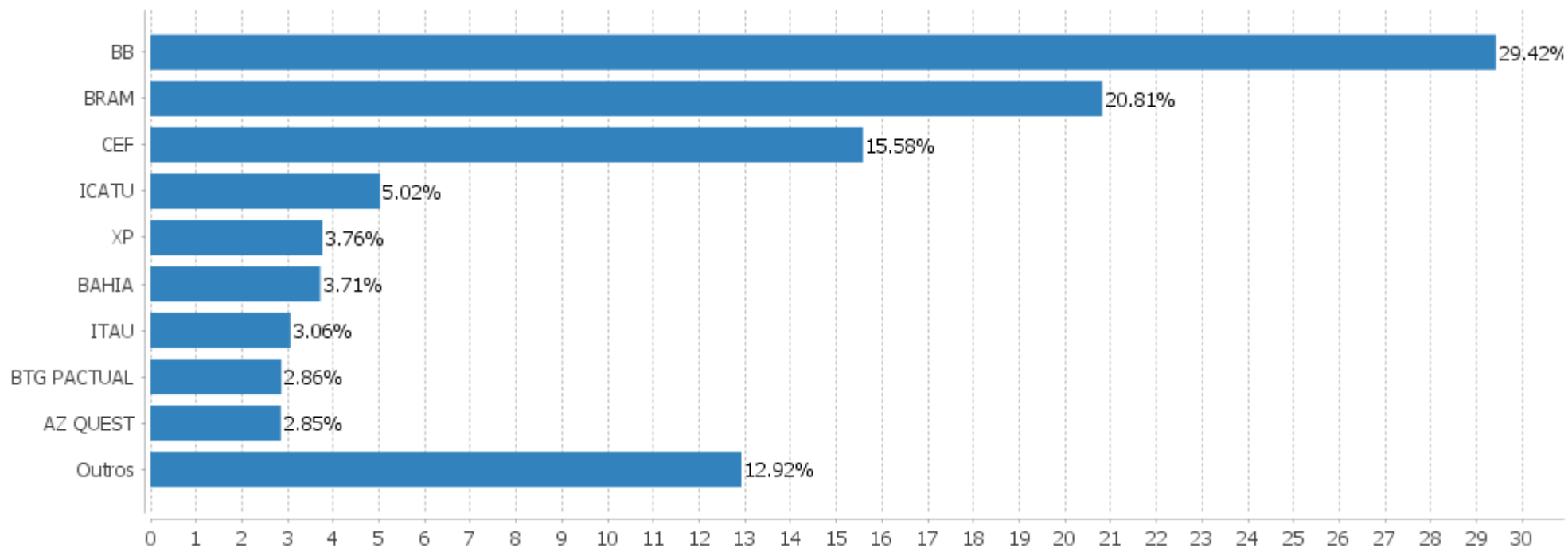


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,81												-0,81
IPCA + 4,00%	0,56												0,56
p.p. indexador	-1,37												-1,37
2020	0,28	-1,11	-9,36	2,51	2,33	2,64	3,17	-0,69	-1,23	0,03	3,24	3,68	4,85
IPCA + 4,00%	0,55	0,53	0,41	0,00	-0,07	0,59	0,72	0,57	0,97	1,19	1,20	1,70	8,68
p.p. indexador	-0,27	-1,64	-9,77	2,51	2,40	2,05	2,45	-1,26	-2,20	-1,16	2,04	1,98	-3,83
2019	2,30	0,36	0,55	0,99	2,45	2,67	1,09	0,05	2,12	2,30	-1,00	2,52	17,59
IPCA + 4,00%	0,66	0,74	1,05	0,90	0,47	0,31	0,55	0,45	0,29	0,46	0,82	1,48	8,50
p.p. indexador	1,63	-0,38	-0,49	0,09	1,97	2,36	0,54	-0,40	1,83	1,85	-1,83	1,04	9,10

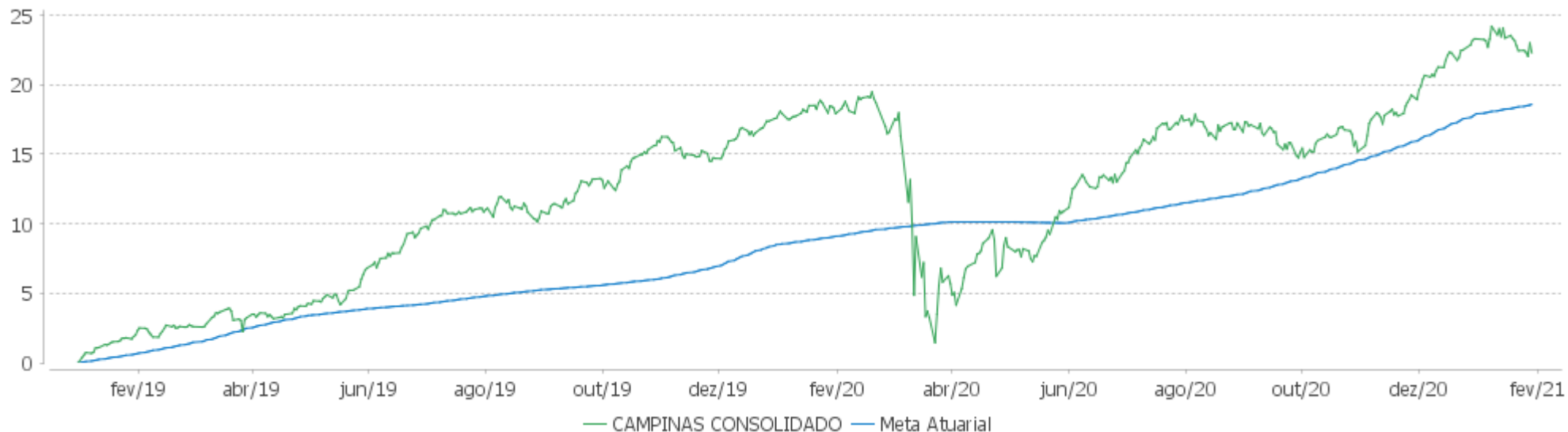
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

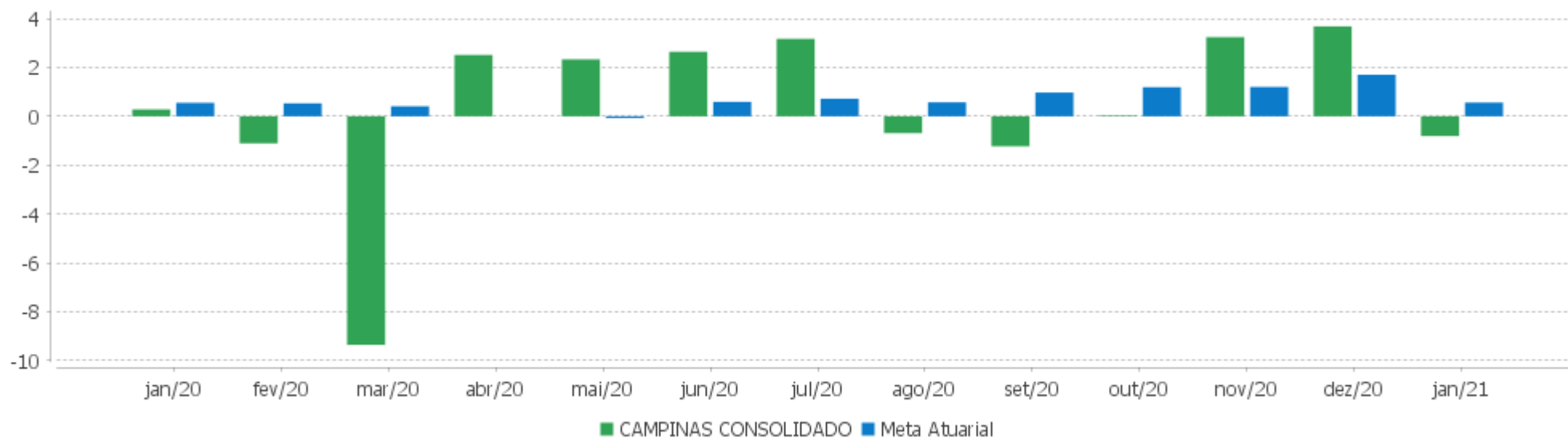
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	56,00	03 meses	6,17	3,50	2,67	5,33
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	44,00	06 meses	4,16	6,35	-2,19	5,58
			12 meses	3,71	8,69	-4,98	11,92
			24 meses	19,56	17,79	1,76	8,83
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	22,30	18,58	3,72	8,66
Menor rentabilidade da Carteira	-9,36	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
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,35 0,24	0,35 0,24	4,13 0,85	4,61 0,81	6,96 -0,60	19,20 -1,32	31,98 -0,71
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV % do CDI	-2,13 -1.427,10	-2,13 -1.427,10	-4,20 -905,10	61,65 6.551,61	30,98 1.226,94	5,67 67,01	-24,98 -162,47
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,10 -0,62	0,10 -0,62	3,47 -0,52	4,22 -3,14	7,17 -3,58	19,51 -2,84	32,76 -1,77
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,25 169,79	0,25 169,79	1,24 268,12	2,50 266,12	0,11 4,23	5,30 62,63	12,48 81,15
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,07 48,60	0,07 48,60	0,09 20,30	1.277,26 135.744,22	1.478,13 58.532,92	72.397,76 856.184,25	25.772,90 167.640,53
FIDC SANASA % do CDI	1,84 1.231,73	1,84 1.231,73	5,28 1.136,51	9,10 967,12	14,84 587,49	26,45 312,77	44,66 290,50
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	56,16 37.569,94	56,16 37.569,94	209,44 45.124,35	1.580,62 167.983,73	2.388,68 94.590,14	7.008,03 82.877,81	4.739,03 30.825,15
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	-1,11 -741,14	-1,11 -741,14	6,26 1.349,37	2,47 262,35	5,42 214,49	25,62 302,94	44,47 289,26
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	3,08 -0,21	3,45 -0,35	7,24 -0,32	19,88 -0,65	31,75 -0,94
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,17 110,47	0,17 110,47	0,58 124,04	0,94 100,20	2,21 87,55	7,89 93,26	14,67 95,44
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,13 -0,12	0,13 -0,12	0,44 -2,07	0,16 -4,14	2,65 -1,91	12,60 3,66	22,91 9,86
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP Var. IPCA p.p.	-0,02 -0,27	-0,02 -0,27	4,19 1,68	4,07 -0,24	7,63 3,07	20,66 11,72	
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,33 0,61	1,33 0,61	4,33 0,34	7,43 0,07	10,71 -0,04	19,17 -3,18	31,01 -3,51
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,67 -0,14	7,34 -0,21	20,01 -0,51	31,87 -0,82
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,29 1,14	0,29 1,14	2,68 -3,36	3,87 1,09	5,71 0,48	15,45 -8,84	26,97 -14,86
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,55	-0,55	2,68	0,93	4,00	15,84	27,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,11	-0,11	0,29	-0,03	0,14	0,48	0,72
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,29 -0,43	0,29 -0,43	2,69 -1,29	4,18 -3,18	7,48 -3,28	20,30 -2,05	42,62 8,09
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,86 -0,01	-0,86 -0,01	6,00 -0,04	2,62 -0,16	4,95 -0,27	23,66 -0,63	40,75 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89 -0,03	-0,89 -0,03	5,95 -0,09	2,61 -0,16	4,86 -0,36	23,44 -0,84	40,37 -1,46
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,70 -0,01	-1,70 -0,01	8,29 -0,14	1,74 -0,27	3,23 -0,45	26,02 -0,81	47,40 -1,29
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT % do CDI	-0,04 -27,40	-0,04 -27,40	0,09 18,95	-1,72 -183,27	-3,38 -134,00	3,63 42,96	12,34 80,25
MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT % do CDI	-0,83 -556,34	-0,83 -556,34	3,06 659,53	-0,19 -20,71	1,41 55,69	9,55 112,92	
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT % do CDI	-0,85 -570,83	-0,85 -570,83	2,87 617,64	2,35 250,07	4,80 190,14	12,96 153,31	20,47 133,17
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-3,32 -0,00	-3,32 -0,00	22,26 -0,21	11,68 -0,13	1,02 -0,13	17,63 -0,51	34,23 -1,28
FIP LSH - MULTISTRATÉGIA % do CDI	-0,04 -29,59	-0,04 -29,59	-0,13 -28,56	-0,26 -27,49	-0,53 -20,80	-1,05 -12,42	-73,66 -479,14
BGT PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,62 2,70	-0,62 2,70	13,66 -8,81	7,92 -3,89	5,08 3,93	38,70 20,56	67,53 32,02
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,44 -0,13	-3,44 -0,13	21,23 -1,25	11,61 -0,20	17,77 16,62		
RIO VERDE SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,21 0,11	-3,21 0,11	13,08 -9,40	-5,37 -17,18	-14,37 -15,52	18,55 0,40	61,81 26,30
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,25 -0,93	-4,25 -0,93	20,75 -1,72	5,77 -6,04	1,31 0,17	24,49 6,34	65,96 30,45
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,01 1,31	-2,01 1,31	21,79 -0,69				
BRANCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-2,48 0,84	-2,48 0,84	13,85 -8,62	13,11 1,30	-4,84 -5,98	13,16 -4,98	33,95 -1,56
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,88 1,44	-1,88 1,44	22,49 0,02	13,88 2,06	4,32 3,17	26,25 8,10	52,35 16,84
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	-1,91	-1,91	17,10	4,52	-11,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	1,52	1,52	-4,00	-6,00	-6,90		
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,12 3,20	-0,12 3,20	18,68 -3,79	12,59 0,78	5,10 3,95	52,87 34,72	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,91 1,41	-1,91 1,41	17,05 -5,42	4,39 -7,42	-10,95 -12,10	33,55 15,40	64,60 29,08
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,92 -0,60	-3,92 -0,60	17,82 -4,65	4,29 -7,52	-13,53 -14,68	10,48 -7,67	38,67 3,16
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,59 -2,27	-5,59 -2,27	22,28 -0,20	14,80 2,99	1,52 0,37	22,76 4,61	50,70 15,19
RBRD11 Var. IBOVESPA p.p.	-6,56 -3,24	-6,56 -3,24	9,13 -13,34	-7,25 -19,06	-12,16 -13,31	9,08 -9,07	32,32 -3,19
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	6,27 1,44	6,27 1,44	11,76 1,06				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,30 3,59	4,30 3,59	8,24 4,25	27,17 19,81	83,37 72,62		
CAMPINAS CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,81 -1,37	-0,81 -1,37	6,17 2,67	4,16 -2,19	3,71 -4,98	19,56 1,76	
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
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
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
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-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
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
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
652	04/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.720,37006000	2,3019865620
616	05/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	640.000,00	278.005,13505900	2,3021157500
664	05/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.031,49070600	2,3021157500
638	05/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	145.000,00	62.985,53841200	2,3021157500
653	07/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	42.000,00	18.242,34934600	2,3023350340
617	08/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.360.000,00	590.645,25346500	2,3025665440
654	08/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	434.297,98048900	2,3025665440
648	08/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.000,00	5.645,87374600	2,3025665440
639	08/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	380.000,00	165.033,23258600	2,3025665440
665	08/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.514,46970700	2,3025665440
655	11/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	110.000,00	47.771,15930400	2,3026445580
646	11/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000,00	1.302,84979900	2,3026445580
635	11/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000,00	1.302,84979900	2,3026445580
656	14/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.391,97023300	2,3032399500
618	15/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.750.000,00	1.193.879,39278400	2,3034152500
649	15/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.389,65727100	2,3034152500
640	15/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.620.000,00	703.303,49684000	2,3034152500
661	15/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.170,68980500	2,3034152500
666	15/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.000,00	36.901,72668600	2,3034152500
657	15/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	34.731,03688100	2,3034152500
658	18/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.170,45404200	2,3036654560
651	18/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500,00	217,04540400	2,3036654560
641	19/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000.000,00	868.089,38730500	2,3039102070
614	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.430.849,46	0,00	6.697.102,46095600	2,3041083140
619	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.400.000,00	3.211.654,57154800	2,3041083140
634	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.164.851,72	0,00	505.554,23671800	2,3041083140
628	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.084.906,42	0,00	470.857,38695800	2,3041083140
642	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.776.000,00	2.940.833,96983900	2,3041083140

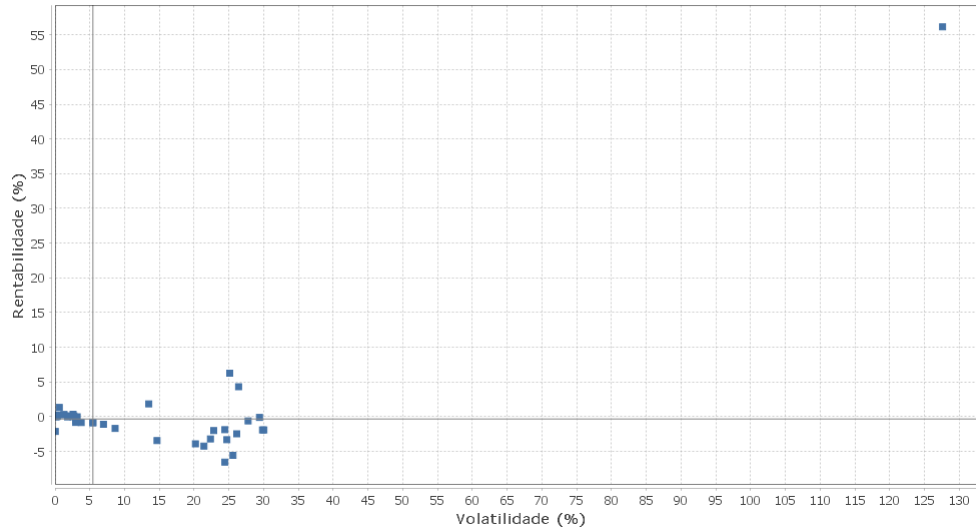
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
636	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.472,05899600	2,3041083140
630	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.400.000,00	0,00	607.610,32434600	2,3041083140
624	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.764.213,84	0,00	9.011.821,93295100	2,3041083140
647	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.472,05899600	2,3041083140
662	20/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	300.000,00	130.202,21236000	2,3041083140
659	22/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.509,42476800	2,3043510810
643	22/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000,00	433,96165100	2,3043510810
637	22/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.000,00	43.396,16511800	2,3043510810
621	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	36.155.000,00	15.683.570,46851400	2,3052786400
620	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	5.205,44449200	2,3052786400
667	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.185.592,99	514.294,87500100	2,3052786400
645	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.530.000,00	6.736.712,74722800	2,3052786400
663	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	587.000,00	254.632,99308600	2,3052786400
660	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	300.000,00	130.136,11230900	2,3052786400
650	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.224.354,71	531.109,20682500	2,3052786400
644	28/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.689,35205200	2,3052786400
622	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.572,53	0,00	3.718,18690500	2,3055672610
615	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.312.644,11	0,00	569.336,72341900	2,3055672610
626	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.040,70	0,00	2.620,04934800	2,3055672610
623	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	101.036,00	0,00	43.822,62088300	2,3055672610
631	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	40.000,00	0,00	17.349,30950600	2,3055672610
625	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.000,00	0,00	13.879,44760500	2,3055672610
633	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	823.229,55	0,00	357.061,60645300	2,3055672610
627	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.204,55	0,00	12.666,96942300	2,3055672610
632	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	16.760,32	0,00	7.269,49947700	2,3055672610
629	29/01/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	17.140,74	0,00	7.434,50008500	2,3055672610
Total						

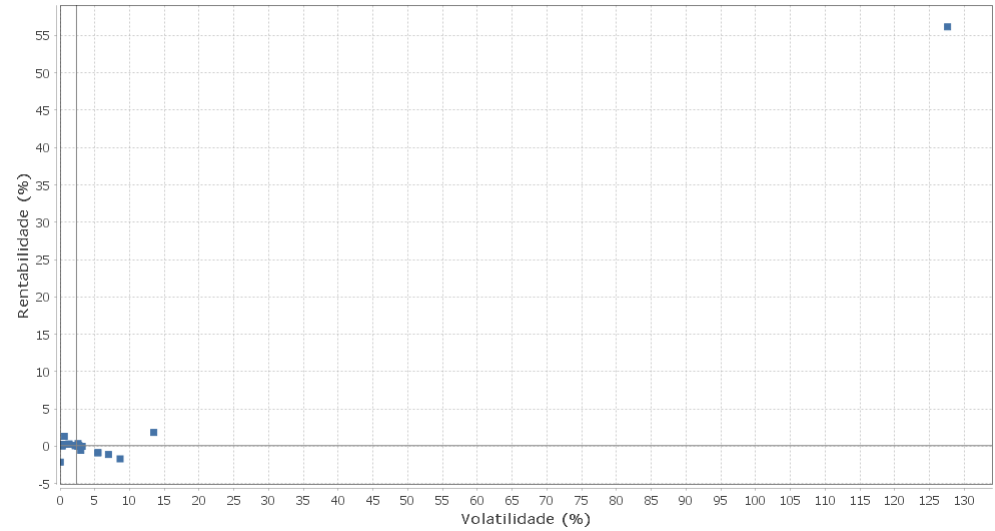
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

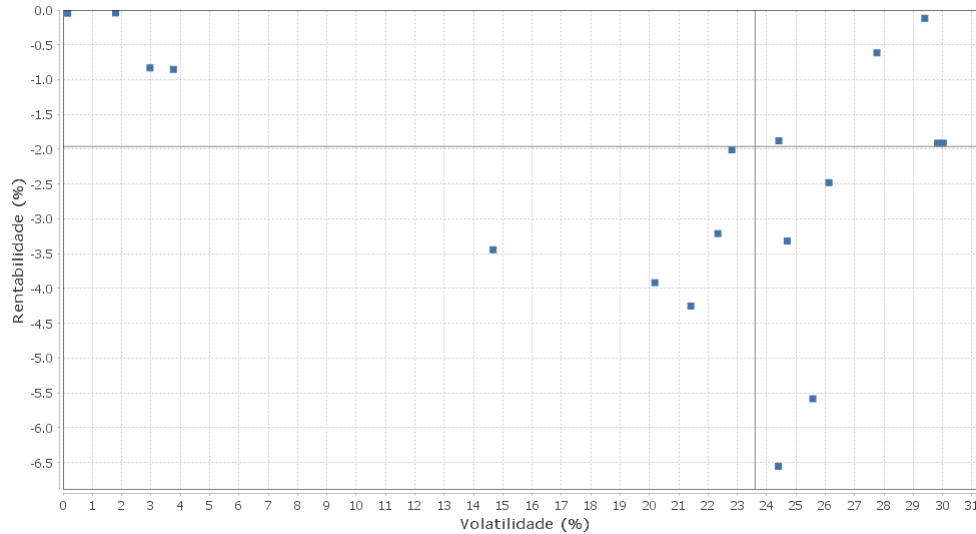
CAMPINAS CONSOLIDADO - No Mês



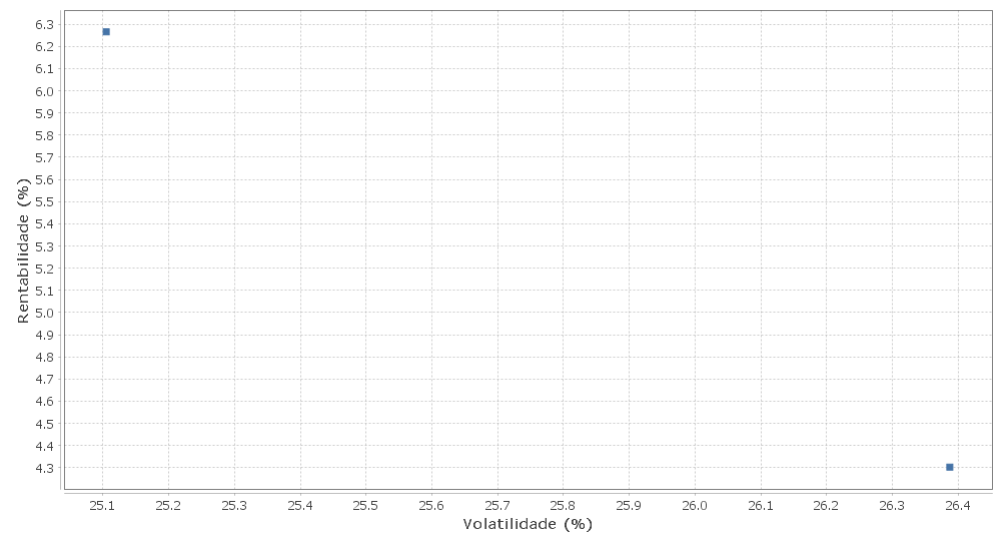
Renda Fixa - No Mês



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\$): 29.626.587,05

Value-At-Risk: 3,35%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,00	-1,01	0,13	27.080.637,73	3,06
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,03	0,21	0,00	-78,32	-2,13	279.103,30	0,03
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,09	0,00	0,29	0,17	69.642.140,13	7,87
FIP LSH - MULTISTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,16	0,01	0,00	-1,23	-0,04	3.933.874,56	0,44
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	0,26	1,50	-0,00	-0,30	0,07	407.269,85	0,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	1.518.401,87	0,17
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,38	0,20	0,00	0,28	0,25	3.977.793,91	0,45
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,22	0,00	1,92	1,33	15.065.690,00	1,70
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,27	1,09	0,00	0,11	0,29	1.987.128,95	0,22
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,28	1,09	0,01	0,11	0,29	14.010.736,36	1,58
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULT	Artigo 8º III	1,79	0,74	0,00	-0,11	-0,04	4.308.295,00	0,49
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,02	-0,03	0,08	25.008.002,60	2,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,07	-0,03	0,08	83.968.440,13	9,49
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,55	1,37	0,06	-0,07	-0,02	64.044.287,40	7,24
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	2,59	1,25	0,01	0,08	0,35	14.013.112,46	1,58
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,71	1,16	0,00	-0,02	0,10	2.382.778,59	0,27
MAUÁ INSTITUCIONAL FICFI MULT	Artigo 8º III	2,97	1,80	0,01	-0,33	-0,83	6.331.837,23	0,72
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,06	-0,23	-0,55	57.437.247,98	6,49
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º III, Alínea a	3,18	1,43	0,01	-0,05	-0,02	10.629.081,45	1,20
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FI MULT	Artigo 8º III	3,77	2,03	0,01	-0,27	-0,85	4.729.354,31	0,53
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,43	2,57	0,13	-0,19	-0,89	66.431.679,42	7,51
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,12	-0,19	-0,86	62.392.404,00	7,05
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,95	2,85	0,07	-0,18	-1,11	31.888.024,82	3,60
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,63	4,24	0,13	-0,21	-1,70	41.604.801,63	4,70
FIDC SANASA	Artigo 7º VII, Alínea a	13,47	0,59	0,00	0,13	1,84	4.233.459,96	0,48
TARPON GT 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,67	8,37	0,10	-0,24	-3,44	18.697.741,64	2,11
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	9,82	0,31	-0,20	-3,92	30.404.391,81	3,44
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,41	10,55	0,17	-0,21	-4,25	15.791.679,44	1,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO VERDE SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,33	10,76	0,06	-0,15	-3,21	5.720.577,14	0,65
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,81	11,54	0,05	-0,09	-2,01	6.039.546,26	0,68
RBRD11	Artigo 8º IV, Alínea b	24,40	0,26	-0,00	-0,27	-6,56	1.988.377,27	0,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,41	11,25	0,40	-0,08	-1,88	32.846.801,23	3,71
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	Artigo 8º I, Alínea a	24,70	11,62	0,46	-0,14	-3,32	37.305.713,05	4,22
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	Artigo 9º A, II	25,10	11,61	-0,01	0,24	6,27	11.073.179,29	1,25
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,58	11,21	0,12	-0,22	-5,59	10.855.103,24	1,23
BRADERCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	26,13	11,48	0,24	-0,10	-2,48	21.762.880,85	2,46
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,39	13,23	0,00	0,16	4,30	17.876.509,41	2,02
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,76	13,04	0,33	-0,03	-0,62	25.346.307,07	2,86
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,39	11,64	0,12	-0,01	-0,12	10.845.707,06	1,23
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,83	11,56	0,11	-0,07	-1,91	9.201.342,15	1,04
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,02	12,02	0,14	-0,07	-1,91	11.667.544,83	1,32
FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER III	Artigo 7º VII, Alínea a	127,60	103,61	0,00	0,44	56,16	21.615,87	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 17,22% do patrimônio líquido do fundo FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF (Art. 7, Inciso I, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 14,82% do patrimônio líquido do fundo URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREV (Art. 7, Inciso VII, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Mediante Nota Técnica nº 12/2017/CGACI/SRPPS/SPREV-MF, Perguntas e Respostas - Resolução CMN nº 3.922/2010 (alterações da Resolução CMN nº 4.604/2017 e Resolução CMN nº 4.695/2018), especificamente a questão de nº 61, o enquadramento do fundo TARPON GT 30 FIC FIA, cnpj: 35.726.741/0001-39 , para fins de verificação dos limites dispostos no art. 14 da Resolução CMN nº 3.922/2010, está levando em consideração o patrimônio líquido do fundo "Master", tendo em vista que é neste que ocorre efetivamente a gestão dos recursos, com a transação de ativos finais;
- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 22,51% dos recursos totais do Instituto, alocação está superior ao limite máximos estipulado em Política de Investimentos;
- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 22,51% dos recursos totais do Instituto, percentual está superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;