

2020

Relatório Mensal, 4º trimestre e ano de 2020

Dezembro Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, ítem 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|---|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 30.334.173,56 | 11,76% | 9.568.490.825,39 | 0,32% | 7º Ib |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 277.435,35 | 0,11% | 8.476.640.995,31 | 0,00% | 7º Ib |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 709.825,64 | 0,28% | 8.693.778.987,76 | 0,01% | 7º Ib |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 11.893.001,00 | 4,61% | 8.522.749.810,66 | 0,14% | 7º Ib |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.760.868,71 | 1,07% | 8.554.614.280,00 | 0,03% | 7º Ib |
| BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 9.020.090,51 | 3,50% | 842.553.482,20 | 1,07% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 39.837.142,80 | 15,44% | 14.722.139.597,34 | 0,27% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 19.986.857,73 | 7,75% | 10.655.087.063,09 | 0,19% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 32.953.410,85 | 12,78% | 20.761.505.098,56 | 0,16% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 193.516,86 | 0,08% | 1.733.830.686,04 | 0,01% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 430.517,39 | 0,17% | 6.193.173.925,17 | 0,01% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.537.796,74 | 2,92% | 1.195.459.257,45 | 0,63% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 28.198.660,41 | 10,93% | 16.753.976.831,37 | 0,17% | 7º Ib |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 50.253,60 | 0,02% | 2.814.559.159,07 | 0,00% | 7º Ib |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 371.472,05 | 0,14% | 249.647.805,06 | 0,15% | 7º Ib |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 325.712,58 | 0,13% | 2.989.829.287,39 | 0,01% | 7º III a |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 644.798,49 | 0,25% | 1.391.144.513,85 | 0,05% | 7º IV a |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 11.943.592,12 | 4,63% | 2.596.482.307,62 | 0,46% | 7º IV a |
| BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 19.211.440,43 | 7,45% | 1.422.915.185,87 | 1,35% | 7º IV a |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 386.935,76 | 0,15% | 954.945.016,55 | 0,04% | 7º IV a |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 2.141.201,49 | 0,83% | 3.168.557.239,02 | 0,07% | 7º IV a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 16.452.172,35 | 6,38% | 3.882.685.363,64 | 0,42% | 7º IV a |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | 1.302.662,46 | 0,51% | 632.876.961,39 | 0,21% | 7º IV a |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 5.999.622,40 | 2,33% | 199.070.839,42 | 3,01% | 7º VII b |
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 554.839,43 | 0,22% | 218.923.792,06 | 0,25% | 8º I a |
| BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 212.384,76 | 0,08% | 1.837.636.759,23 | 0,01% | 8º II a |
| BRADERCO SELECTION FI AÇÕES | 228.260,15 | 0,09% | 831.343.765,94 | 0,03% | 8º II a |

Investimentos

\$ 257.946.849,73

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 257.946.849,73

Governança (Pró Gestão)

⚙️ Não possui

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|--|--------------|------------|------------------|-------|----------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 4.073.900,23 | 1,58% | 4.359.163.323,49 | 0,09% | 8º II a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.659.511,49 | 1,03% | 1.875.685.360,54 | 0,14% | 8º II a |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 547.116,11 | 0,21% | 669.620.221,50 | 0,08% | 8º II a |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 511.935,98 | 0,20% | 243.912.947,40 | 0,21% | 8º II a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 329.716,97 | 0,13% | 71.591.349,17 | 0,46% | 8º III |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 3.475.646,72 | 1,35% | 1.995.120.518,18 | 0,17% | 8º III |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 236.965,72 | 0,09% | 428.489.928,37 | 0,06% | 8º III |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.153.410,89 | 0,83% | 1.987.917.698,76 | 0,11% | 9º A III |

Investimentos

\$ 257.946.849,73

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 257.946.849,73

Governança (Pró Gestão)

☑ Não possui

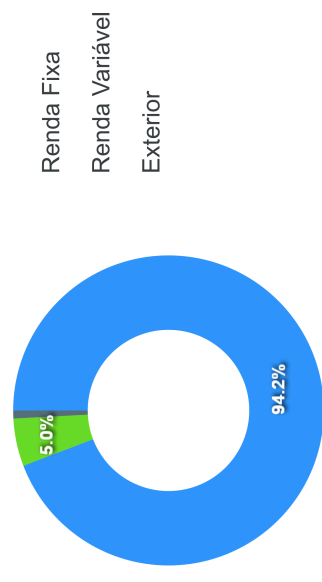
| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Utilizado (%) | Livre |
|---|------------|----------------|---------------|----------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 184.555.023,20 | 71,55% | 73.391.826,53 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 325.712,58 | 0,13% | 154.442.397,26 |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa | 40,00% | 52.082.803,10 | 20,19% | 51.095.936,79 |
| 7º VII b - FI Renda Fixa - Crédito Privado | 5,00% | 5.999.622,40 | 2,33% | 6.897.720,09 |
| 8º I a - FI Referenciados em Renda Variável | 30,00% | 554.839,43 | 0,22% | 76.829.215,49 |
| 8º II a - FI em Ações | 20,00% | 8.233.108,72 | 3,19% | 43.356.261,23 |
| 8º III - FI Multimercado | 10,00% | 4.042.329,41 | 1,57% | 21.752.355,56 |
| 9º A III - Ações - BDR Nível I | 10,00% | 2.153.410,89 | 0,83% | 23.641.274,08 |

Governança (Pró Gestão)

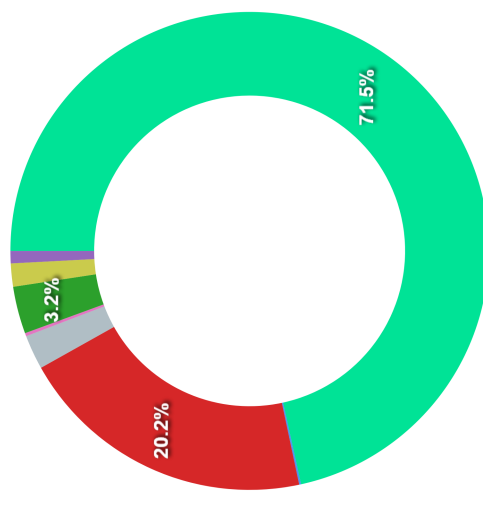


Não possui

Segmentos



Artigos

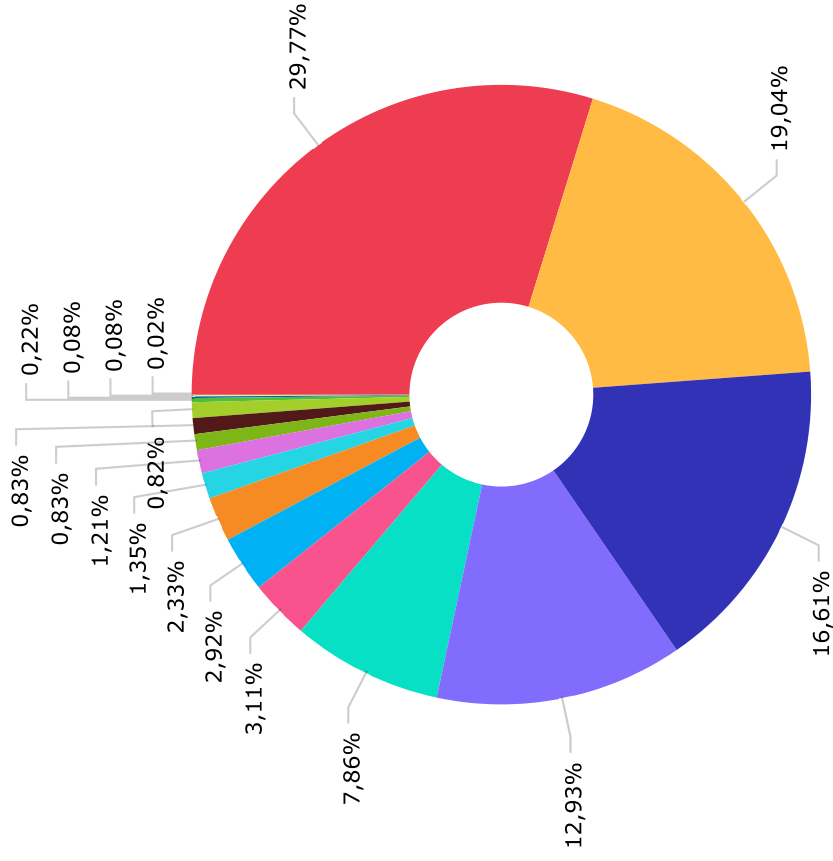


| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior | Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|-------|----------|----------------|-----------------------------------|-------|----------|-------|----------|---------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% | 257.946.849,73 | 8º I a - FI Referenciados em R... | 0,22% | 0,00% | 0,00% | 30,00% | 76.829.215,49 |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 71,55% | 0,00% | 0,00% | 100,00% | 73.391.826,53 | 8º I b - FI de Índices Referen... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 30,00% | 77.384.054,92 |
| 7º I c - ETF 100% Títulos TN | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% | 257.946.849,73 | 8º II a - FI em Ações | 3,19% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 43.356.261,23 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 0,13% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 154.442.397,26 | 8º II b - FI em Índices de Açõ... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 51.589.369,95 |
| 7º III b - FI de Índices Refer... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 154.768.109,84 | 8º III - FI Multimercado | 1,57% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 21.752.355,56 |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa | 20,19% | 0,00% | 0,00% | 40,00% | 51.095.936,79 | 8º IV b - FI Imobiliário | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 12.897.342,49 |
| 7º IV b - FI de Índices Renda ... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 40,00% | 103.178.739,89 | 9º A I - Renda Fixa - Dívida E... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 25.794.684,97 |
| 7º V b - Letras Imobiliárias G... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 12.897.342,49 | 9º A II - Constituídos no Bras... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 25.794.684,97 |
| 7º VII b - FI Renda Fixa - Cré... | 2,33% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 6.897.720,09 | 9º A III - Ações - BDR Nivel I | 0,83% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 23.641.274,08 |
| 7º VII c - FI de Debêntures In... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 12.897.342,49 | | | | | | |

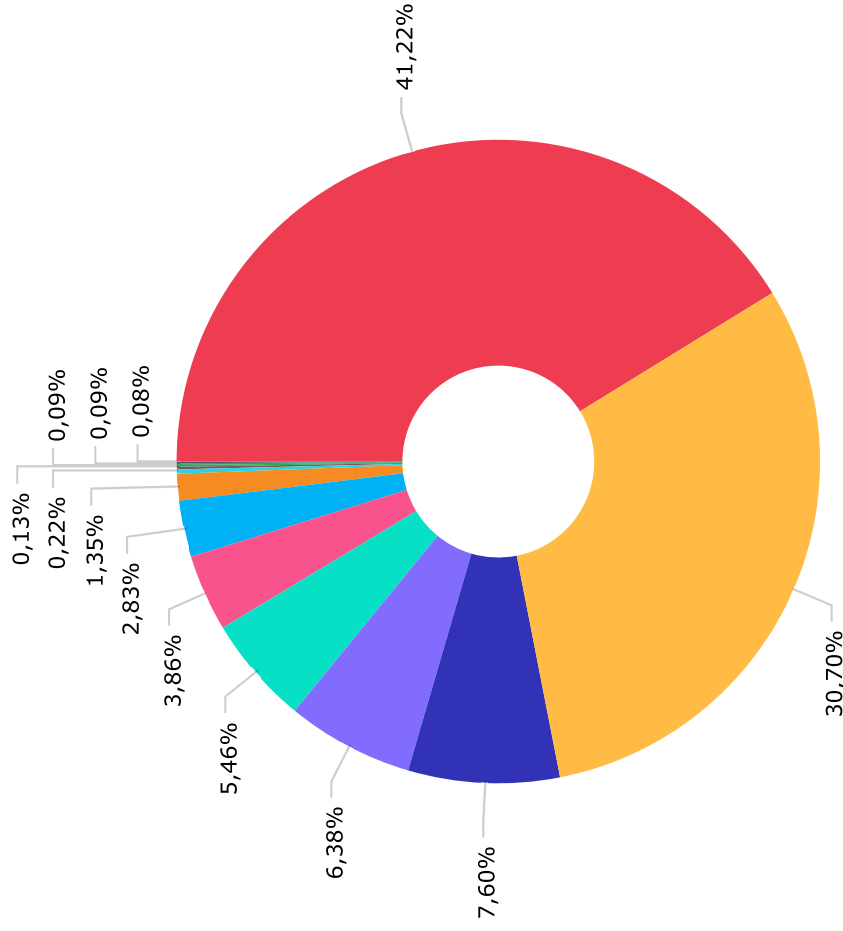
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|-----------|--------------------|
| CDI - BENCHMARK | 0,16 | 2,76 | 0,47 | 0,99 | 2,76 | 8,88 | | |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,38 | 5,09 | 3,17 | 3,28 | 5,09 | 18,83 | 1,02 | 2,15 |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,25 | 2,40 | 0,57 | 1,01 | 2,40 | 8,28 | 0,02 | 0,04 |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 1,48 | 5,68 | 3,93 | 4,73 | 5,68 | 16,13 | | |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 0,35 | 3,30 | 0,69 | 1,14 | 3,30 | 10,52 | 0,11 | 0,22 |
| GLOBAL BDRX - BENCHMARK | 0,93 | 54,01 | 1,70 | 16,29 | 54,01 | 108,94 | | |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 0,69 | 54,76 | 1,31 | 16,49 | 54,76 | 108,09 | 7,07 | 14,89 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | 9,30 | 2,92 | 25,81 | 25,21 | 2,92 | 35,42 | | |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 7,90 | -3,67 | 20,63 | 27,64 | -3,67 | 22,88 | 6,96 | 14,65 |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 6,30 | -4,87 | 19,94 | 22,34 | -4,87 | 38,19 | 6,12 | 12,90 |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 6,83 | -5,21 | 13,16 | 15,19 | -5,21 | 41,54 | 6,55 | 13,79 |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 8,07 | -15,62 | 16,10 | 11,25 | -15,62 | 28,39 | 7,91 | 16,66 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 7,97 | -21,23 | 17,87 | 10,19 | -21,23 | 10,15 | 6,55 | 13,79 |
| IBX - BENCHMARK | 9,15 | 3,50 | 25,34 | 25,28 | 3,50 | 38,06 | | |
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 9,04 | 1,17 | 24,83 | 24,05 | 1,17 | 31,65 | 6,92 | 14,57 |
| IDIV - BENCHMARK | 8,94 | -1,00 | 25,44 | 21,29 | -1,00 | 43,71 | | |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 9,43 | -5,65 | 25,79 | 21,37 | -5,65 | 16,62 | 6,90 | 14,54 |
| IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK | 1,73 | 8,62 | 3,05 | 5,10 | 8,62 | 21,46 | | |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,65 | 8,03 | 3,05 | 4,76 | 8,03 | 20,12 | 0,71 | 1,49 |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,53 | 7,92 | 3,22 | 4,89 | 7,92 | 20,01 | 0,66 | 1,39 |
| IMA GERAL - BENCHMARK | 2,02 | 5,34 | 2,86 | 3,40 | 5,34 | 18,84 | | |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | Var - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|-------------|-------------|--------------|--------------|-------------|--------------|-----------|--------------------|
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,11 | 4,82 | 2,85 | 3,16 | 4,82 | 17,74 | 0,89 | 1,88 |
| IMA-B - BENCHMARK | 4,85 | 6,41 | 7,18 | 8,21 | 6,41 | 30,83 | | |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4,84 | 6,14 | 7,13 | 8,03 | 6,14 | 30,17 | 2,03 | 4,28 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4,84 | 6,06 | 7,13 | 8,09 | 6,06 | 30,02 | 2,04 | 4,29 |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 4,85 | 6,05 | 7,10 | 8,06 | 6,05 | 29,87 | 2,04 | 4,29 |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4,81 | 5,91 | 7,04 | 8,01 | 5,91 | 29,81 | 2,04 | 4,29 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 1,83 | 8,04 | 3,38 | 4,72 | 8,04 | 22,25 | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,82 | 7,75 | 3,32 | 4,57 | 7,75 | 21,60 | 0,74 | 1,55 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 1,78 | 7,86 | 3,23 | 4,48 | 7,86 | 21,79 | 0,77 | 1,62 |
| IMA-B 5+ - BENCHMARK | 7,51 | 5,50 | 10,53 | 11,36 | 5,50 | 37,54 | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7,56 | 5,23 | 10,56 | 11,28 | 5,23 | 36,52 | 3,42 | 7,19 |
| IPCA - BENCHMARK | 1,35 | 4,52 | 3,13 | 4,42 | 4,52 | 9,02 | | |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1,32 | 6,66 | 2,04 | 1,95 | 6,66 | 24,19 | 0,55 | 1,17 |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | 2,62 | 8,40 | 4,47 | 6,15 | 8,40 | 23,04 | 0,99 | 2,09 |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2,48 | 4,66 | 3,00 | 2,83 | 4,66 | 17,68 | 1,14 | 2,41 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,20 | 2,86 | 0,38 | 0,58 | 2,86 | 15,12 | 0,02 | 0,04 |
| IRF-M - BENCHMARK | 1,96 | 6,70 | 1,99 | 1,75 | 6,70 | 19,53 | | |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,96 | 6,40 | 1,99 | 1,64 | 6,40 | 18,94 | 1,04 | 2,19 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 0,34 | 3,48 | 0,65 | 1,00 | 3,48 | 10,23 | 0,10 | 0,21 |
| IRF-M 1 - BENCHMARK | 0,31 | 3,84 | 0,70 | 1,21 | 3,84 | 10,86 | | |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,28 | 3,63 | 0,64 | 1,12 | 3,63 | 10,42 | 0,10 | 0,21 |

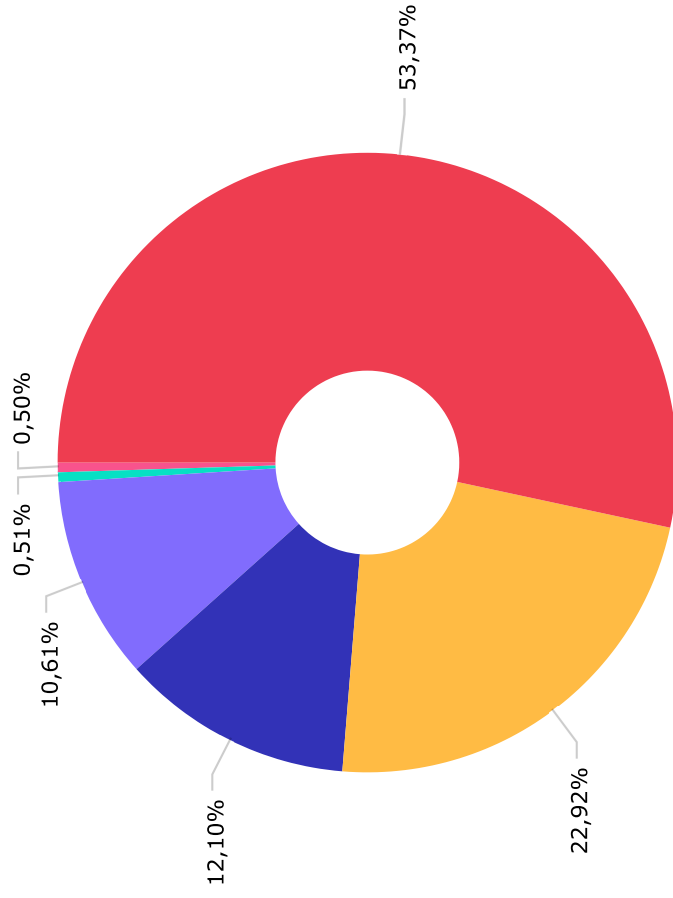
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,33 | 3,48 | 0,67 | 1,01 | 3,48 | 10,18 | 0,10 | 0,21 |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,31 | 3,47 | 0,63 | 0,99 | 3,47 | 10,19 | 0,10 | 0,21 |
| IRF-M 1+ - BENCHMARK | 3,05 | 8,45 | 2,90 | 2,29 | 8,45 | 23,90 | | |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3,04 | 8,22 | 2,90 | 2,21 | 8,22 | 23,25 | 1,69 | 3,56 |
| S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK | 3,71 | 16,26 | 11,69 | 21,15 | 16,26 | 49,83 | | |
| ITAU PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO | 3,06 | 12,93 | 11,36 | 20,06 | 12,93 | 49,53 | 4,46 | 9,39 |
| SELIC - BENCHMARK | 0,16 | 2,76 | 0,47 | 0,99 | 2,76 | 8,88 | | |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,22 | 2,13 | 0,41 | 0,96 | 2,13 | 8,09 | 0,02 | 0,05 |
| IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK | 1,87 | 10,76 | 4,65 | 7,55 | 10,76 | 22,49 | | |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1,78 | 7,59 | 2,87 | 3,90 | 7,59 | 25,32 | 0,71 | 1,49 |



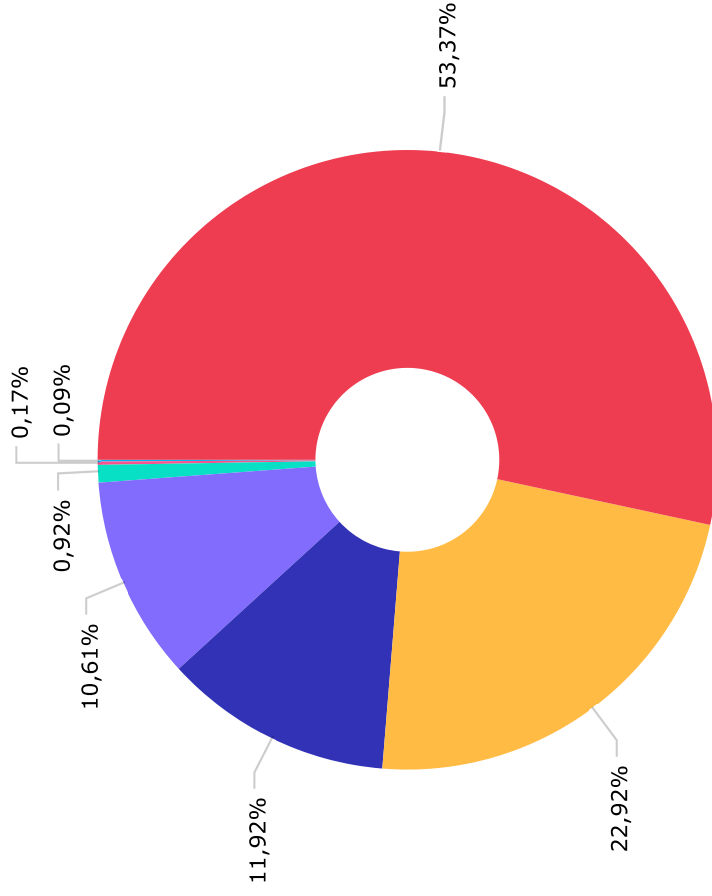
| | |
|--------------------------|---------------|
| IPCA | 76.803.418,04 |
| IRF-M 1 | 49.111.751,92 |
| CDI | 42.844.448,37 |
| IMA-B 5 | 33.340.346,61 |
| IDKA IPCA 2 Anos | 20.264.293,08 |
| Ibovespa | 8.020.723,96 |
| IMA Geral | 7.537.796,74 |
| IPCA + 6,00% ao ano | 5.999.622,40 |
| S&P 500 (Moeda Original) | 3.475.646,72 |
| IRF-M | 3.132.340,76 |
| Global BDRX | 2.153.410,89 |
| Selic | 2.141.201,49 |
| IMA-B | 2.110.854,10 |
| IBX | 554.839,43 |
| IDIV | 212.384,76 |
| IMA-B 5+ | 193.516,86 |
| IRF-M 1+ | 50.253,60 |



| | |
|---|----------------|
| Renda Fixa Indexados | 106.334.127,40 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano | 79.191.406,87 |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento | 19.598.376,19 |
| Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre | 16.452.172,35 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 14.084.793,61 |
| Ações Livre | 9.945.874,70 |
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 7.302.284,86 |
| Multimercados Estratégia Específica | 3.475.646,72 |
| Ações Indexados | 554.839,43 |
| Multimercados Juros e Moedas | 329.716,97 |
| Multimercados Macro | 236.965,72 |
| Ações Índice Ativo | 228.260,15 |
| Ações Dividendos | 212.384,76 |



| Management | Value |
|------------------------------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 137.666.902,25 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 59.118.534,30 |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEM... | 31.200.313,10 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 27.362.419,81 |
| XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA... | 1.302.662,46 |
| XP GESTAO DE RECURSOS LTDA | 1.296.017,81 |



| Administrador | Valor |
|-----------------------------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 137.666.902,25 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 59.118.534,30 |
| BANCO BRADESCO S.A. | 30.759.668,19 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 27.362.419,81 |
| INTRAG DTVM LTDA | 2.361.714,55 |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 440.644,91 |
| BNY MELLON SERVICOS FINANCEIRO... | 236.965,72 |

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 224.454.039,47 | 1.806.166,41 | 464.263,84 | 227.072.452,80 | 1.276.510,76 | 1.276.510,76 | 0,57% ▲ | 0,57% | 0,71% | 0,71% | 80,28% | 0,99% |
| Fevereiro | 227.072.452,80 | 18.218.124,97 | 16.770.078,99 | 228.313.992,89 | -206.505,89 | 1.070.004,87 | -0,09% ▼ | 0,47% | 0,66% | 1,37% | 34,31% | 1,47% |
| Março | 228.313.992,89 | 1.911.652,93 | 437.454,03 | 224.520.746,59 | -5.267.445,20 | -4.197.440,33 | -2,29% ▼ | -1,83% | 0,57% | 1,95% | -93,85% | 6,99% |
| Abril | 224.520.746,59 | 2.226.174,73 | 418.311,87 | 228.867.596,24 | 2.538.986,79 | -1.658.453,54 | 1,12% ▲ | -0,73% | 0,14% | 2,10% | -34,76% | 4,07% |
| Mai | 228.867.596,24 | 1.958.683,12 | 448.311,87 | 233.339.058,83 | 2.961.091,34 | 1.302.637,80 | 1,29% ▲ | 0,55% | 0,07% | 2,17% | 25,35% | 1,82% |
| Junho | 233.339.058,83 | 1.960.539,59 | 557.069,88 | 237.093.296,18 | 2.360.767,64 | 3.663.405,44 | 1,01% ▲ | 1,56% | 0,74% | 2,92% | 53,42% | 1,42% |
| Julho | 237.093.296,18 | 1.884.405,10 | 488.694,23 | 241.370.286,52 | 2.881.279,47 | 6.544.684,91 | 1,21% ▲ | 2,79% | 0,88% | 3,83% | 72,85% | 1,12% |
| Agosto | 241.370.286,52 | 2.090.312,23 | 445.865,84 | 242.841.703,69 | -173.029,22 | 6.371.655,69 | -0,07% ▼ | 2,71% | 0,72% | 4,58% | 59,17% | 1,12% |
| Setembro | 242.841.703,69 | 2.181.734,19 | 479.494,84 | 243.093.392,21 | -1.450.550,83 | 4.921.104,86 | -0,59% ▼ | 2,10% | 1,12% | 5,75% | 36,52% | 1,79% |
| Outubro | 243.093.392,21 | 6.741.905,46 | 5.195.810,83 | 244.455.281,16 | -184.205,68 | 4.736.899,18 | -0,08% ▼ | 2,03% | 1,34% | 7,17% | 28,31% | 1,45% |
| Novembro | 244.455.281,16 | 3.885.625,78 | 541.419,57 | 250.750.034,59 | 2.950.547,22 | 7.687.446,40 | 1,19% ▲ | 3,24% | 1,35% | 8,61% | 37,63% | 1,22% |
| Dezembro | 250.750.034,59 | 3.979.244,72 | 759.864,28 | 257.946.849,73 | 3.977.434,70 | 11.664.881,10 | 1,57% ▲ | 4,86% | 1,86% | 10,63% | 45,72% | 0,88% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

| Período | Retorno \$ | Retorno % | Meta % |
|---------|---------------|-----------|--------|
| 1º Trim | -4.197.440,33 | -1,83% | 1,95% |
| 2º Trim | 7.860.845,77 | 3,45% | 0,95% |
| 1º Sem | 3.663.405,44 | 1,56% | 2,92% |
| 3º Trim | 1.257.699,42 | 0,54% | 2,75% |
| 4º Trim | 6.743.776,24 | 2,70% | 4,61% |
| 2º Sem | 8.001.475,66 | 3,25% | 7,48% |

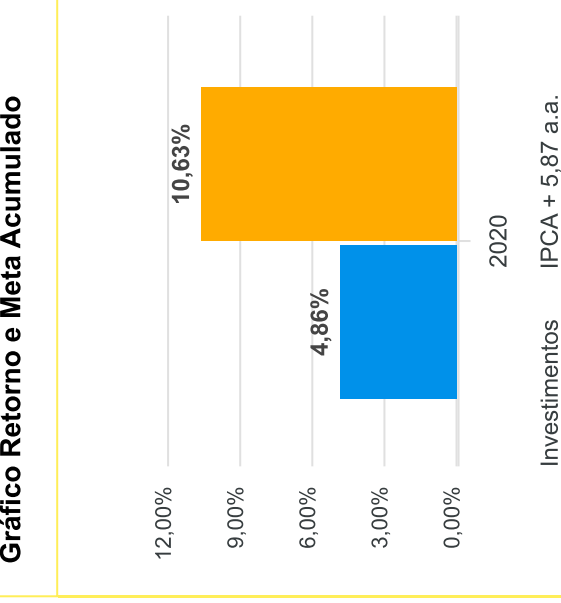


Gráfico Risco x Retorno

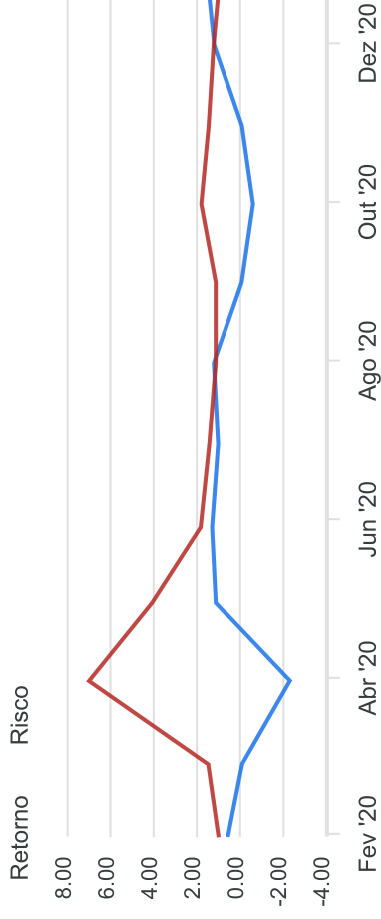
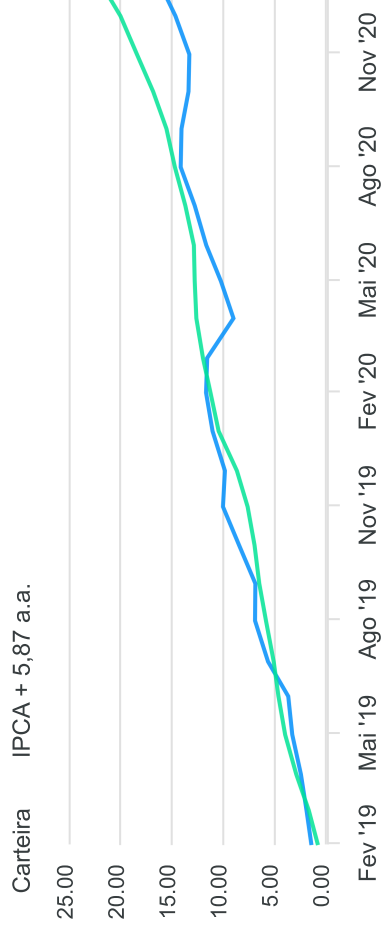
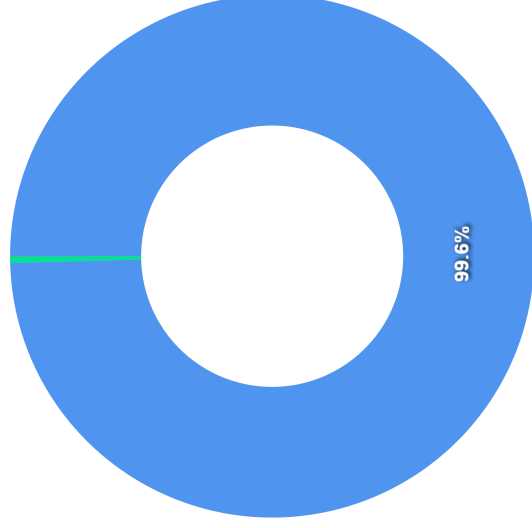


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/12/2020

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|----------------|-------|
| Até D+30 | 256.887.797,64 | 99,59 |
| Até D+180 | 1.059.052,09 | 0,41 |
| Até D+360 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+720 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+1800 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Acima D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Indeterminado | 0,00 | 0,00 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|-----------------------|---------------------|-------------------|-----------------------|---------------------|--------------|--------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 29.629.283,79 | 0,00 | 0,00 | 30.334.173,56 | 704.889,77 | 2,38% ▲ | 1,02% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 273.266,32 | 0,00 | 0,00 | 277.435,35 | 4.169,03 | 1,53% ▲ | 0,66% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 615.224,99 | 0,00 | 0,00 | 644.798,49 | 29.573,50 | 4,81% ▲ | 2,04% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 677.083,04 | 0,00 | 0,00 | 709.825,64 | 32.742,60 | 4,84% ▲ | 2,03% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 11.855.898,66 | 0,00 | 0,00 | 11.893.001,00 | 37.102,34 | 0,31% ▲ | 0,10% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.707.678,25 | 0,00 | 0,00 | 2.760.868,71 | 53.190,46 | 1,96% ▲ | 1,04% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 11.913.617,01 | 0,00 | 0,00 | 11.943.592,12 | 29.975,11 | 0,25% ▲ | 0,02% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 18.746.570,73 | 0,00 | 0,00 | 19.211.440,43 | 464.869,70 | 2,48% ▲ | 1,14% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 380.177,65 | 0,00 | 0,00 | 386.935,76 | 6.758,11 | 1,78% ▲ | 0,77% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 8.990.849,79 | 0,00 | 0,00 | 9.020.090,51 | 29.240,72 | 0,33% ▲ | 0,10% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 2.136.587,43 | 0,00 | 0,00 | 2.141.201,49 | 4.614,06 | 0,22% ▲ | 0,02% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 39.317.885,98 | 0,00 | 0,00 | 39.837.142,80 | 519.256,82 | 1,32% ▲ | 0,55% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 19.661.912,57 | 0,00 | 0,00 | 19.986.857,73 | 324.945,16 | 1,65% ▲ | 0,71% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 30.360.702,80 | 2.024.695,65 | 0,00 | 32.953.410,85 | 568.012,40 | 1,75% ▲ | 0,74% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 179.910,28 | 0,00 | 0,00 | 193.516,86 | 13.606,58 | 7,56% ▲ | 3,42% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 410.640,54 | 0,00 | 0,00 | 430.517,39 | 19.876,85 | 4,84% ▲ | 2,04% |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.382.270,08 | 0,00 | 0,00 | 7.537.796,74 | 155.526,66 | 2,11% ▲ | 0,89% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 5.894.764,80 | 0,00 | 0,00 | 5.999.622,40 | 104.857,60 | 1,78% ▲ | 0,71% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 26.928.332,96 | 1.954.549,07 | 759.864,28 | 28.198.660,41 | 75.642,66 | 0,26% ▲ | 0,10% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 48.772,09 | 0,00 | 0,00 | 50.253,60 | 1.481,51 | 3,04% ▲ | 1,69% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 310.635,10 | 0,00 | 0,00 | 325.712,58 | 15.077,48 | 4,85% ▲ | 2,04% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 16.418.979,77 | 0,00 | 0,00 | 16.452.172,35 | 33.192,58 | 0,20% ▲ | 0,02% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 370.201,50 | 0,00 | 0,00 | 371.472,05 | 1.270,55 | 0,34% ▲ | 0,10% |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | 1.269.403,50 | 0,00 | 0,00 | 1.302.662,46 | 33.258,96 | 2,62% ▲ | 0,99% |
| | 236.480.649,63 | 3.979.244,72 | 759.864,28 | 242.963.161,28 | 3.263.131,21 | 1,36% | 0,57% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 508.852,11 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 45.987,32 | 9,04% ▲ | 6,92% |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 194.085,83 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | 18.298,93 | 9,43% ▲ | 6,90% |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 211.539,48 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | 16.720,67 | 7,90% ▲ | 6,96% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 3.832.623,58 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | 241.276,65 | 6,30% ▲ | 6,12% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 328.566,01 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 1.150,96 | 0,35% ▲ | 0,11% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.463.209,49 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | 196.302,00 | 7,97% ▲ | 6,55% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO | 3.372.578,86 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 103.067,86 | 3,06% ▲ | 4,46% |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 512.145,22 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | 34.970,89 | 6,83% ▲ | 6,55% |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 473.705,39 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | 38.230,59 | 8,07% ▲ | 7,91% |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 233.500,45 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 3.465,27 | 1,48% ▲ | - |
| - | 12.130.806,42 | 0,00 | 0,00 | 12.830.277,56 | 699.471,14 | 5,77% | 5,75% |

| ESTRUTURADOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 508.852,11 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 45.987,32 | 9,04% ▲ | 6,92% |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 194.085,83 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | 18.298,93 | 9,43% ▲ | 6,90% |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 211.539,48 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | 16.720,67 | 7,90% ▲ | 6,96% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 3.832.623,58 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | 241.276,65 | 6,30% ▲ | 6,12% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 328.566,01 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 1.150,96 | 0,35% ▲ | 0,11% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.463.209,49 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | 196.302,00 | 7,97% ▲ | 6,55% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO | 3.372.578,86 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 103.067,86 | 3,06% ▲ | 4,46% |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 512.145,22 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | 34.970,89 | 6,83% ▲ | 6,55% |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 473.705,39 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | 38.230,59 | 8,07% ▲ | 7,91% |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 233.500,45 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 3.465,27 | 1,48% ▲ | - |
| - | 12.130.806,42 | 0,00 | 0,00 | 12.830.277,56 | 699.471,14 | 5,77% | 5,75% |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 508.852,11 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 45.987,32 | 9,04% ▲ | 6,92% |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 194.085,83 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | 18.298,93 | 9,43% ▲ | 6,90% |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 211.539,48 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | 16.720,67 | 7,90% ▲ | 6,96% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 3.832.623,58 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | 241.276,65 | 6,30% ▲ | 6,12% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 328.566,01 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 1.150,96 | 0,35% ▲ | 0,11% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.463.209,49 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | 196.302,00 | 7,97% ▲ | 6,55% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO | 3.372.578,86 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 103.067,86 | 3,06% ▲ | 4,46% |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 512.145,22 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | 34.970,89 | 6,83% ▲ | 6,55% |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 473.705,39 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | 38.230,59 | 8,07% ▲ | 7,91% |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 233.500,45 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 3.465,27 | 1,48% ▲ | - |
| - | 12.130.806,42 | 0,00 | 0,00 | 12.830.277,56 | 699.471,14 | 5,77% | 5,75% |

| | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | | | | | | | |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.138.578,54 | 0,00 | 0,00 | 2.153.410,89 | 14.832,35 | 0,69% ▲ | 7,07% |
| | 2.138.578,54 | 0,00 | 0,00 | 2.153.410,89 | 14.832,35 | 0,69% | 0,00% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|---------------|--------------|----------------|--------------|-----------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 29.400.804,89 | 0,00 | 0,00 | 30.334.173,56 | 933.368,67 | 3,17% ▲ |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 268.769,71 | 0,00 | 0,00 | 277.435,35 | 8.665,64 | 3,22% ▲ |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 602.381,70 | 0,00 | 0,00 | 644.798,49 | 42.416,79 | 7,04% ▲ |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 662.554,21 | 0,00 | 0,00 | 709.825,64 | 47.271,43 | 7,13% ▲ |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 11.819.127,83 | 0,00 | 0,00 | 11.893.001,00 | 73.873,17 | 0,63% ▲ |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.706.941,95 | 0,00 | 0,00 | 2.760.868,71 | 53.926,76 | 1,99% ▲ |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 11.875.906,86 | 0,00 | 0,00 | 11.943.592,12 | 67.685,26 | 0,57% ▲ |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 18.652.728,00 | 0,00 | 0,00 | 19.211.440,43 | 558.712,43 | 3,00% ▲ |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 374.836,81 | 0,00 | 0,00 | 386.935,76 | 12.098,95 | 3,23% ▲ |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 8.959.972,84 | 0,00 | 0,00 | 9.020.090,51 | 60.117,67 | 0,67% ▲ |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 2.132.478,39 | 0,00 | 0,00 | 2.141.201,49 | 8.723,10 | 0,41% ▲ |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 39.040.198,45 | 0,00 | 0,00 | 39.837.142,80 | 796.944,35 | 2,04% ▲ |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 19.395.698,17 | 0,00 | 0,00 | 19.986.857,73 | 591.159,56 | 3,05% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 19.495.636,25 | 12.500.526,10 | 0,00 | 32.953.410,85 | 957.248,50 | 2,99% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 175.029,08 | 0,00 | 0,00 | 193.516,86 | 18.487,78 | 10,56% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 401.856,54 | 0,00 | 0,00 | 430.517,39 | 28.660,85 | 7,13% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.329.238,97 | 0,00 | 0,00 | 7.537.796,74 | 208.557,77 | 2,85% ▲ |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 5.832.000,00 | 0,00 | 0,00 | 5.999.622,40 | 167.622,40 | 2,87% ▲ |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 27.741.138,98 | 2.106.249,86 | 1.822.384,03 | 28.198.660,41 | 173.655,60 | 0,58% ▲ |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 48.835,49 | 0,00 | 0,00 | 50.253,60 | 1.418,11 | 2,90% ▲ |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 304.107,59 | 0,00 | 0,00 | 325.712,58 | 21.604,99 | 7,10% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 16.389.108,44 | 0,00 | 0,00 | 16.452.172,35 | 63.063,91 | 0,38% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 369.082,89 | 0,00 | 0,00 | 371.472,05 | 2.389,16 | 0,65% ▲ |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | 1.246.942,48 | 0,00 | 0,00 | 1.302.662,46 | 55.719,98 | 4,47% ▲ |
| | 225.225.376,52 | 14.606.775,96 | 1.822.384,03 | 242.963.161,28 | 4.953.392,83 | 2,08% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|--------------|---------------|--------------|-----------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 444.480,19 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 110.359,24 | 24,83% ▲ |
| BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES | 168.842,33 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | 43.542,43 | 25,79% ▲ |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 189.218,75 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | 39.041,40 | 20,63% ▲ |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.686.170,18 | 0,00 | 4.674.710,65 | 0,00 | -11.459,53 | -0,24% ▼ |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 3.396.602,66 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | 677.297,57 | 19,94% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 327.453,83 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 2.263,14 | 0,69% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.256.296,03 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | 403.215,46 | 17,87% ▲ |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 3.120.994,92 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 354.651,80 | 11,36% ▲ |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 483.485,12 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | 63.630,99 | 13,16% ▲ |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 440.961,80 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | 70.974,18 | 16,10% ▲ |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 228.008,22 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 8.957,50 | 3,93% ▲ |
| | 15.742.514,03 | 0,00 | 4.674.710,65 | 12.830.277,56 | 1.762.474,18 | 11,20% |

| ESTRUTURADOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|--------------|---------------|--------------|-----------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 444.480,19 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 110.359,24 | 24,83% ▲ |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 168.842,33 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | 43.542,43 | 25,79% ▲ |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 189.218,75 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | 39.041,40 | 20,63% ▲ |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.686.170,18 | 0,00 | 4.674.710,65 | 0,00 | -11.459,53 | -0,24% ▼ |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 3.396.602,66 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | 677.297,57 | 19,94% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 327.453,83 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 2.263,14 | 0,69% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.256.296,03 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | 403.215,46 | 17,87% ▲ |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 3.120.994,92 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 354.651,80 | 11,36% ▲ |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 483.485,12 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | 63.630,99 | 13,16% ▲ |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 440.961,80 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | 70.974,18 | 16,10% ▲ |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 228.008,22 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 8.957,50 | 3,93% ▲ |
| | 15.742.514,03 | 0,00 | 4.674.710,65 | 12.830.277,56 | 1.762.474,18 | 11,20% |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|--------------|---------------|--------------|-----------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 444.480,19 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 110.359,24 | 24,83% ▲ |
| BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES | 168.842,33 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | 43.542,43 | 25,79% ▲ |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 189.218,75 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | 39.041,40 | 20,63% ▲ |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.686.170,18 | 0,00 | 4.674.710,65 | 0,00 | -11.459,53 | -0,24% ▼ |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 3.396.602,66 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | 677.297,57 | 19,94% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 327.453,83 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 2.263,14 | 0,69% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.256.296,03 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | 403.215,46 | 17,87% ▲ |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 3.120.994,92 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 354.651,80 | 11,36% ▲ |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 483.485,12 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | 63.630,99 | 13,16% ▲ |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 440.961,80 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | 70.974,18 | 16,10% ▲ |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 228.008,22 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 8.957,50 | 3,93% ▲ |
| | 15.742.514,03 | 0,00 | 4.674.710,65 | 12.830.277,56 | 1.762.474,18 | 11,20% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|--|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.125.501,66 | 0,00 | 0,00 | 2.153.410,89 | 27.909,23 | 1,31% ▲ |
| | 2.125.501,66 | 0,00 | 0,00 | 2.153.410,89 | 27.909,23 | 1,31% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|-----------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 28.864.978,28 | 0,00 | 0,00 | 30.334.173,56 | 1.469.195,28 | 5,09% ▲ |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 257.084,99 | 0,00 | 0,00 | 277.435,35 | 20.350,36 | 7,92% ▲ |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 608.790,65 | 0,00 | 0,00 | 644.798,49 | 36.007,84 | 5,91% ▲ |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 668.761,26 | 0,00 | 0,00 | 709.825,64 | 41.064,38 | 6,14% ▲ |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 11.494.385,48 | 0,00 | 0,00 | 11.893.001,00 | 398.615,52 | 3,47% ▲ |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 7.544.008,00 | 0,00 | 5.000.000,00 | 2.760.868,71 | 216.860,71 | 2,87% ▲ |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 6.684.747,15 | 5.000.000,00 | 0,00 | 11.943.592,12 | 258.844,97 | 2,22% ▲ |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 18.355.672,66 | 0,00 | 0,00 | 19.211.440,43 | 855.767,77 | 4,66% ▲ |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 358.753,98 | 0,00 | 0,00 | 386.935,76 | 28.181,78 | 7,86% ▲ |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 8.716.835,53 | 0,00 | 0,00 | 9.020.090,51 | 303.254,98 | 3,48% ▲ |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 2.096.576,46 | 0,00 | 0,00 | 2.141.201,49 | 44.625,03 | 2,13% ▲ |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 37.348.056,31 | 0,00 | 0,00 | 39.837.142,80 | 2.489.086,49 | 6,66% ▲ |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.500.912,94 | 0,00 | 0,00 | 19.986.857,73 | 1.485.944,79 | 8,03% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.002.951,72 | 18.396.336,75 | 5.000.000,00 | 32.953.410,85 | 1.554.122,38 | 4,27% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 174.818,73 | 8.871,88 | 0,00 | 193.516,86 | 9.826,25 | 5,35% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 405.911,55 | 0,00 | 0,00 | 430.517,39 | 24.605,84 | 6,06% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 12.150.610,32 | 0,00 | 5.000.000,00 | 7.537.796,74 | 387.186,42 | 3,19% ▲ |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 5.576.563,20 | 0,00 | 0,00 | 5.999.622,40 | 423.059,20 | 7,59% ▲ |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 7.984.551,06 | 25.406.642,74 | 6.036.328,21 | 28.198.660,41 | 843.794,82 | 2,53% ▲ |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 25.060,69 | 22.717,86 | 0,00 | 50.253,60 | 2.475,05 | 5,18% ▲ |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 294.296,38 | 0,00 | 295.601,21 | 0,00 | 1.304,83 | 0,44% ▲ |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 1.297.846,72 | 0,00 | 1.000.000,00 | 325.712,58 | 27.865,86 | 2,15% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 15.994.445,49 | 0,00 | 0,00 | 16.452.172,35 | 457.726,86 | 2,86% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 358.981,05 | 0,00 | 0,00 | 371.472,05 | 12.491,00 | 3,48% ▲ |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | 1.201.756,72 | 0,00 | 0,00 | 1.302.662,46 | 100.905,74 | 8,40% ▲ |
| | 204.967.357,32 | 48.834.569,23 | 22.331.929,42 | 242.963.161,28 | 11.493.164,15 | 4,97% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------------|-------------|---------------------|----------------------|--------------------|---------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 548.444,44 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 6.394,99 | 1,17% ▲ |
| BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES | 225.096,73 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | -12.711,97 | -5,65% ▼ |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 236.962,15 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | -8.702,00 | -3,67% ▼ |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.620.794,23 | 0,00 | 4.674.710,65 | 0,00 | 53.916,42 | 1,17% ▲ |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 4.282.619,79 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | -208.719,56 | -4,87% ▼ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 319.193,46 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 10.523,51 | 3,30% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 3.376.301,02 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | -716.789,53 | -21,23% ▼ |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 3.077.699,16 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 397.947,56 | 12,93% ▲ |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 577.217,25 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | -30.101,14 | -5,21% ▼ |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 606.708,67 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | -94.772,69 | -15,62% ▼ |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 224.219,42 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 12.746,30 | 5,68% ▲ |
| | 18.095.256,32 | 0,00 | 4.674.710,65 | 12.830.277,56 | -590.268,11 | -3,26% |

| ESTRUTURADOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------------|-------------|---------------------|----------------------|--------------------|---------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 548.444,44 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 6.394,99 | 1,17% ▲ |
| BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES | 225.096,73 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | -12.711,97 | -5,65% ▼ |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 236.962,15 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | -8.702,00 | -3,67% ▼ |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.620.794,23 | 0,00 | 4.674.710,65 | 0,00 | 53.916,42 | 1,17% ▲ |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 4.282.619,79 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | -208.719,56 | -4,87% ▼ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 319.193,46 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 10.523,51 | 3,30% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 3.376.301,02 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | -716.789,53 | -21,23% ▼ |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 3.077.699,16 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 397.947,56 | 12,93% ▲ |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 577.217,25 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | -30.101,14 | -5,21% ▼ |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 606.708,67 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | -94.772,69 | -15,62% ▼ |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 224.219,42 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 12.746,30 | 5,68% ▲ |
| | 18.095.256,32 | 0,00 | 4.674.710,65 | 12.830.277,56 | -590.268,11 | -3,26% |


| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------------|-------------|---------------------|----------------------|--------------------|---------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES | 548.444,44 | 0,00 | 0,00 | 554.839,43 | 6.394,99 | 1,17% ▲ |
| BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES | 225.096,73 | 0,00 | 0,00 | 212.384,76 | -12.711,97 | -5,65% ▼ |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 236.962,15 | 0,00 | 0,00 | 228.260,15 | -8.702,00 | -3,67% ▼ |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.620.794,23 | 0,00 | 4.674.710,65 | 0,00 | 53.916,42 | 1,17% ▲ |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 4.282.619,79 | 0,00 | 0,00 | 4.073.900,23 | -208.719,56 | -4,87% ▼ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO | 319.193,46 | 0,00 | 0,00 | 329.716,97 | 10.523,51 | 3,30% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 3.376.301,02 | 0,00 | 0,00 | 2.659.511,49 | -716.789,53 | -21,23% ▼ |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 3.077.699,16 | 0,00 | 0,00 | 3.475.646,72 | 397.947,56 | 12,93% ▲ |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES | 577.217,25 | 0,00 | 0,00 | 547.116,11 | -30.101,14 | -5,21% ▼ |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES | 606.708,67 | 0,00 | 0,00 | 511.935,98 | -94.772,69 | -15,62% ▼ |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 224.219,42 | 0,00 | 0,00 | 236.965,72 | 12.746,30 | 5,68% ▲ |
| | 18.095.256,32 | 0,00 | 4.674.710,65 | 12.830.277,56 | -590.268,11 | -3,26% |

| | INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|--|---------------------------|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | | 1.391.425,83 | 0,00 | 0,00 | 2.153.410,89 | 761.985,06 | 54,76% ▲ |
| | | 1.391.425,83 | 0,00 | 0,00 | 2.153.410,89 | 761.985,06 | 54,76% |

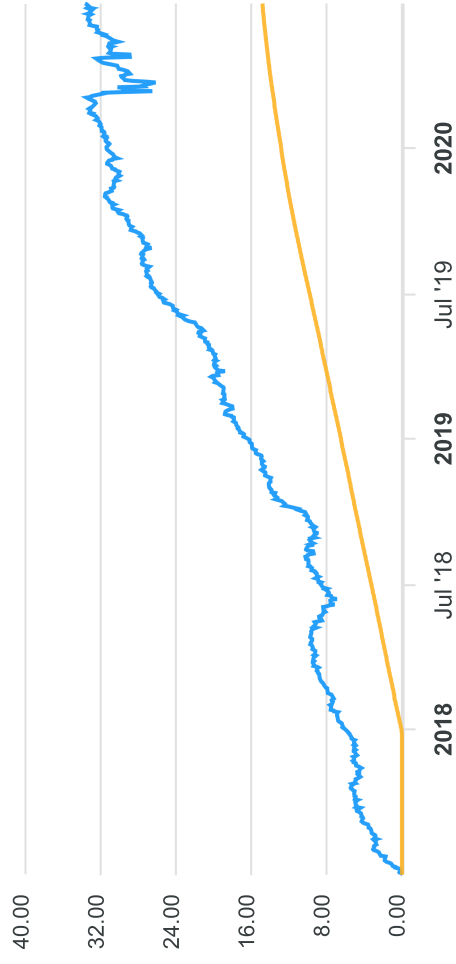
PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 0,30% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+3 |
| Quantidade de Cotistas | 588 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 9.568.490.825,39 |
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | CDI |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Livre Soberano |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em cotas de fundo de investimentos que apresentem carteira composta por ativos financeiros de renda fixa, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). |

COMPARATIVO

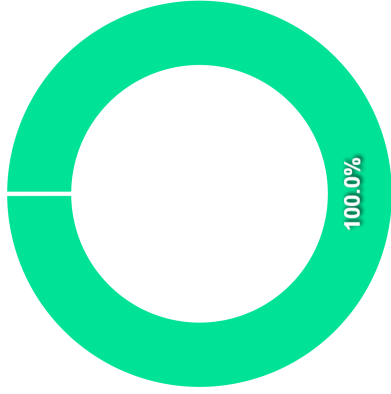
 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 2,38% | 5,09% | 3,17% | 3,28% | 5,09% | 18,83% | 1,02% | 2,15% |
| Benchmark | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



PERFIL DO FUNDO

CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 1.605.214,14 | 41,45 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 1.090.384,95 | 28,16 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 461.653,67 | 11,92 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA | 370.904,60 | 9,58 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA | 343.611,77 | 8,87 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 756,39 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Controladoria | 17,50 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 6,83 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 1,62 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -44,53 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -45,19 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 3.871.769,12 | 99,98% |
| Valores a pagar/receber | 692,63 | 0,02% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---------------------------------|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 922 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 8.476.640.995,31 |

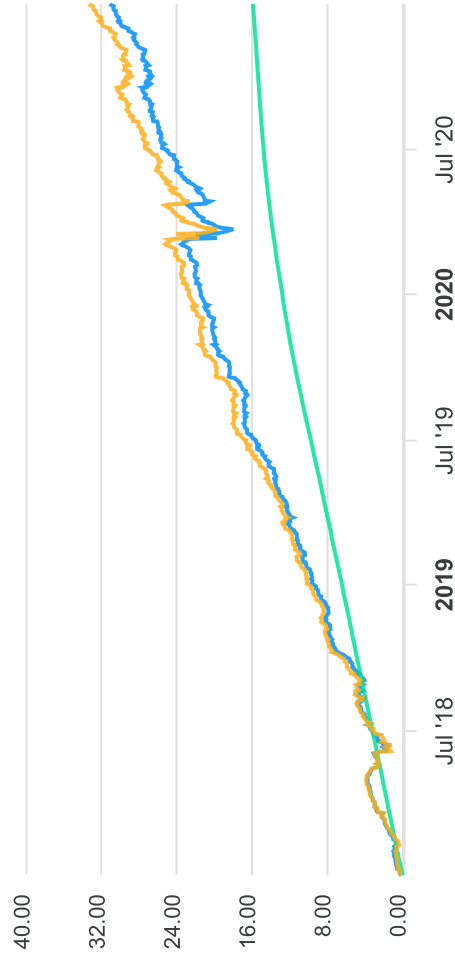
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IDKA IPCA 2 Anos |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

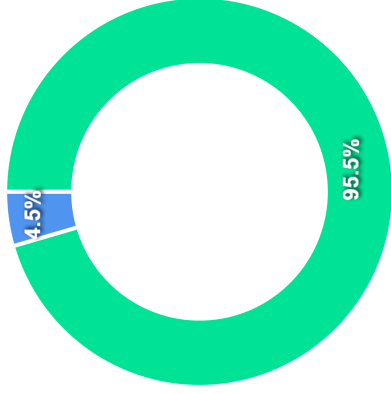
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,53% | 7,92% | 3,22% | 4,89% | 7,92% | 20,01% | 0,66% | 1,39% |
| Benchmark | 1,73% | 8,62% | 3,05% | 5,10% | 8,62% | 21,46% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 6.607.138,50 | 95,50% |
| Operação compromissada | 310.939,81 | 4,49% |
| Valores a pagar/receber | 175,00 | 0,00% |
| Outros | 80,32 | 0,00% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 3.455.182,28 | 49,94 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 2.852.861,96 | 41,24 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 310.939,81 | 4,49 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 299.094,27 | 4,32 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 223,77 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 181,42 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 21,50 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,34 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,17 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,05 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -13,58 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -14,40 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -49,62 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -54,79 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -81,99 | 0,00 | Outros |

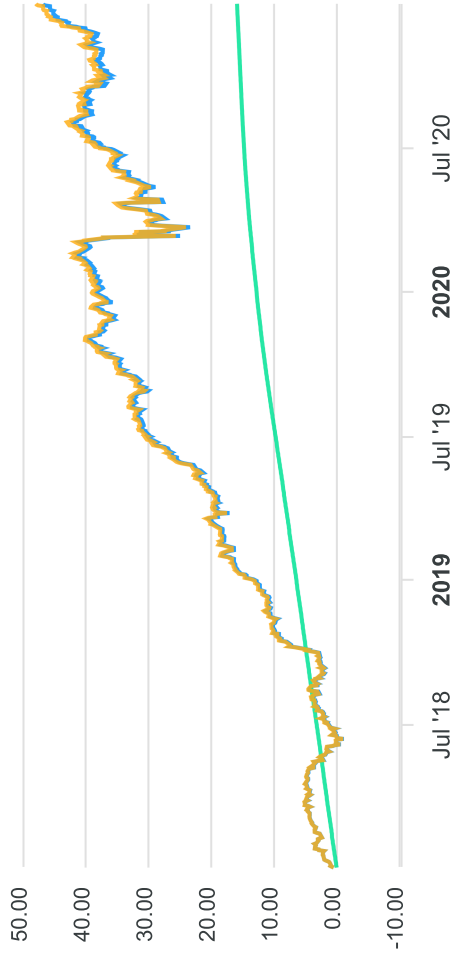
PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 679 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 8.693.778.987,76 |
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IMA-B |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais. |

COMPARATIVO

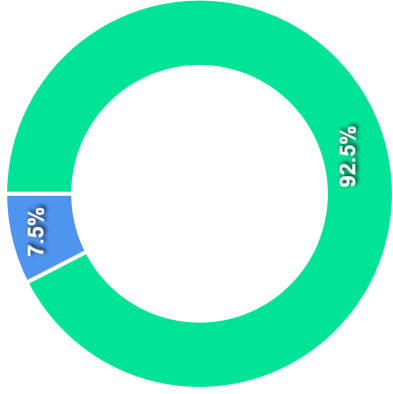
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 4,84% | 6,14% | 7,13% | 8,03% | 6,14% | 30,17% | 2,03% | 4,28% |
| Benchmark | 4,85% | 6,41% | 7,18% | 8,21% | 6,41% | 30,83% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



PERFIL DO FUNDO

CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 5.274.809,08 | 92,48% |
| Operação comprada | 429.019,67 | 7,52% |
| Valores a pagar/receber | 166,36 | 0,00% |
| Outros | -99,29 | -0,00% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 734.255,39 | 12,87 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 567.613,28 | 9,95 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 489.421,44 | 8,58 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 487.087,73 | 8,54 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 460.409,93 | 8,07 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 450.437,99 | 7,90 | Títulos Federais |
| Operações Compradas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 429.019,67 | 7,52 | Operação comprada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 401.892,12 | 7,05 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 394.214,93 | 6,91 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 365.032,50 | 6,40 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 304.564,56 | 5,34 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 247.902,71 | 4,35 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 197.339,20 | 3,46 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 120.359,12 | 2,11 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 54.278,16 | 0,95 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 202,54 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 99,80 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 17,15 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,08 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -2,04 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -3,12 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -21,51 | 0,00 | Outros |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---------------------------------|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 0,10% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 1.225 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 8.522.749.810,66 |

PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IRF-M 1 |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais. |

COMPARATIVO

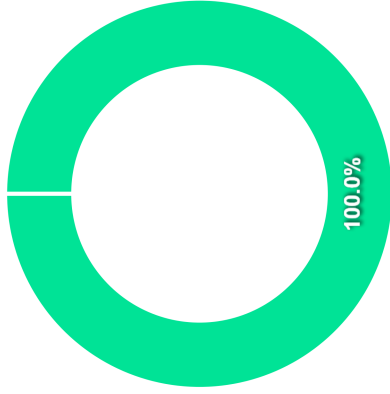
 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,31% | 3,47% | 0,63% | 0,99% | 3,47% | 10,19% | 0,10% | 0,21% |
| Benchmark | 0,31% | 3,84% | 0,70% | 1,21% | 3,84% | 10,86% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB IRF-M 1 FIC RENDA FIXA | 6.481.908,92 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 25,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 6,49 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 6.481.908,92 | 100,00% |
| Valores a pagar/receber | 71,26 | 0,00% |

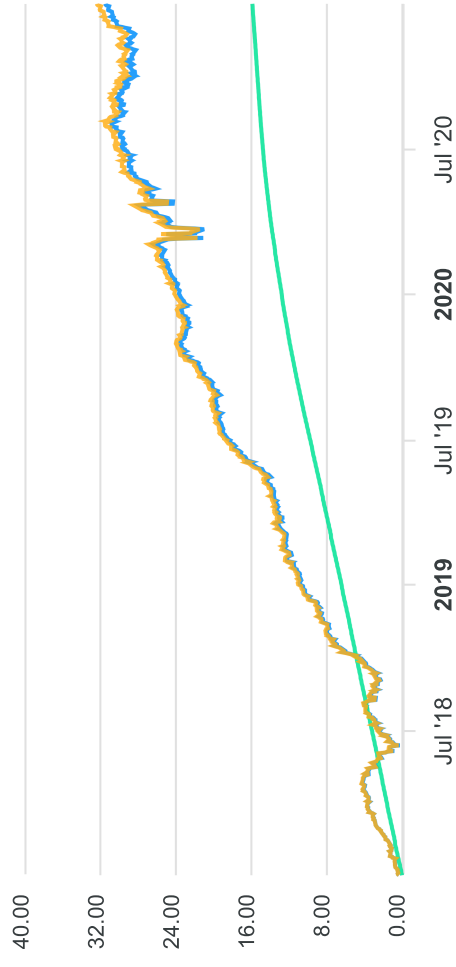
PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 701 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 8.554.614.280,00 |
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IRF-M |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

COMPARATIVO

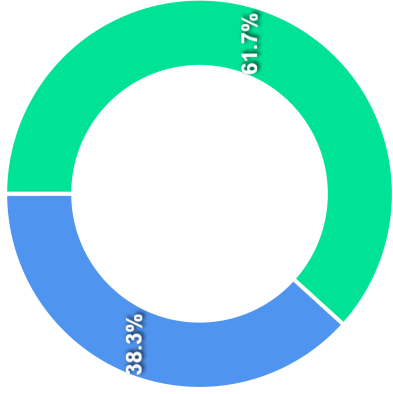
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,96% | 6,40% | 1,99% | 1,64% | 6,40% | 18,94% | 1,04% | 2,19% |
| Benchmark | 1,96% | 6,70% | 1,99% | 1,75% | 6,70% | 19,53% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



PERFIL DO FUNDO

CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 2.387.825,48 | 61.74% |
| Operação comprometida | 1.481.836,66 | 38.31% |
| Valores a pagar/receber | 414,03 | 0.01% |
| Outros | -214,83 | -0.01% |
| Derivativos | -2.265,11 | -0.06% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2029 | 1.481.836,66 | 38,31 | Operação comprometida |
| LTN - Venc.: 01/07/2023 | 525.023,50 | 13,58 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/01/2024 | 394.481,31 | 10,20 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2025 | 326.404,42 | 8,44 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2027 | 271.347,10 | 7,02 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2029 | 126.511,84 | 3,27 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2025 | 98.384,02 | 2,54 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/01/2026 | 70.902,06 | 1,83 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2024 | 64.403,30 | 1,67 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2025 | 64.391,25 | 1,66 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 64.345,78 | 1,66 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2026 | 64.236,35 | 1,66 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2026 | 64.204,41 | 1,66 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/01/2025 | 52.151,95 | 1,35 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/10/2024 | 45.413,64 | 1,17 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2031 | 34.634,35 | 0,90 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2024 | 34.019,01 | 0,88 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/04/2024 | 30.016,90 | 0,78 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/04/2023 | 23.053,70 | 0,60 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2033 | 19.085,55 | 0,49 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2023 | 10.176,32 | 0,26 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/10/2023 | 4.638,70 | 0,12 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 474,79 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 12,25 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,65 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--|
| Administrador | BANCO BRADESCO S.A. |
| Gestão | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 265 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 842.553.482,20 |

PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IRF-M 1 |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Livre Soberano |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável. |

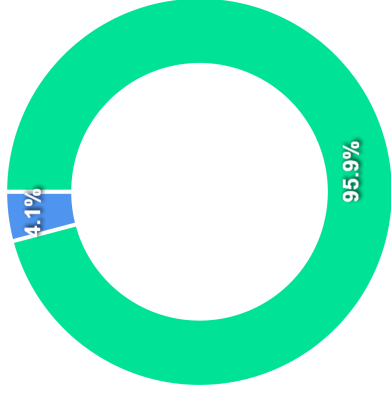
COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,33% | 3,48% | 0,67% | 1,01% | 3,48% | 10,18% | 0,10% | 0,21% |
| Benchmark | 0,31% | 3,84% | 0,70% | 1,21% | 3,84% | 10,86% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 562.895,39 | 95.92% |
| Operação compromissada | 24.049,91 | 4.10% |
| Derivativos | -11,09 | -0.00% |
| Valores a pagar/receber | -119,35 | -0.02% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| LTN - Venc: 01/01/2024 | 270.192,68 | 46,04 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2023 | 148.456,20 | 25,30 | Títulos Federais |
| LFT - Venc: 01/03/2026 | 60.382,17 | 10,29 | Títulos Federais |
| LFT - Venc: 01/09/2025 | 32.172,89 | 5,48 | Títulos Federais |
| LFT - Venc: 01/09/2024 | 25.761,32 | 4,39 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2025 | 24.049,91 | 4,10 | Operação compromissada |
| LFT - Venc.: 01/09/2026 | 16.051,10 | 2,74 | Títulos Federais |
| LTN - Venc: 01/04/2023 | 9.879,03 | 1,68 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 10,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,55 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTN23 | 0,25 | 0,00 | Derivativos |
| Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTJ23 | 0,08 | 0,00 | Derivativos |
| Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTV23 | -1,40 | 0,00 | Derivativos |
| Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTF24 | -10,01 | 0,00 | Derivativos |
| Outros Valores a pagar | -129,91 | -0,02 | Valores a pagar/receber |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 885 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 14.722.139.597,34 |

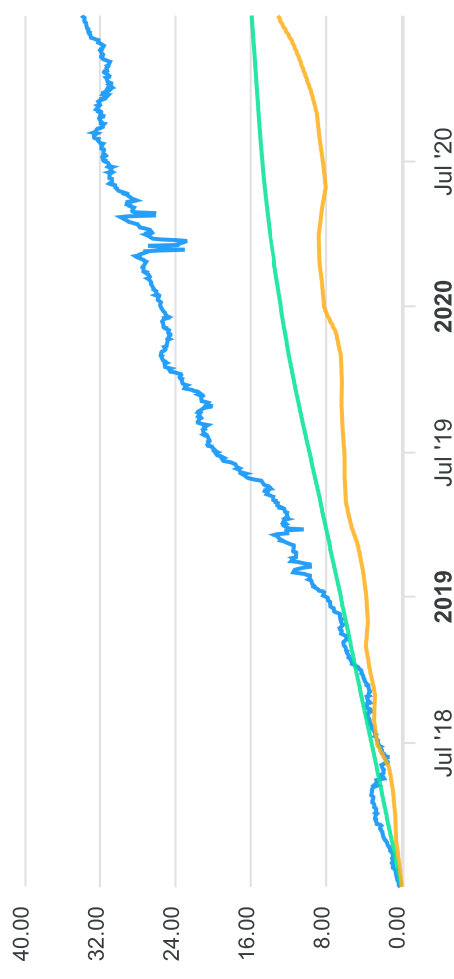
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IPCA |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Livre Soberano |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ: 10.948.555/0001-13. |

COMPARATIVO

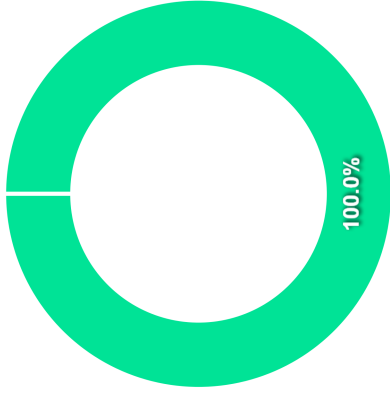
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,32% | 6,66% | 2,04% | 1,95% | 6,66% | 24,19% | 0,55% | 1,17% |
| Benchmark | 1,35% | 4,52% | 3,13% | 4,42% | 4,52% | 9,02% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP | 5.085.557,53 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 0,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 0,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -219,08 | 0,00 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 5.085.557,53 | 100,00% |
| Valores a pagar/receber | -218,50 | -0,00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 1.005 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 10.655.087.063,09 |

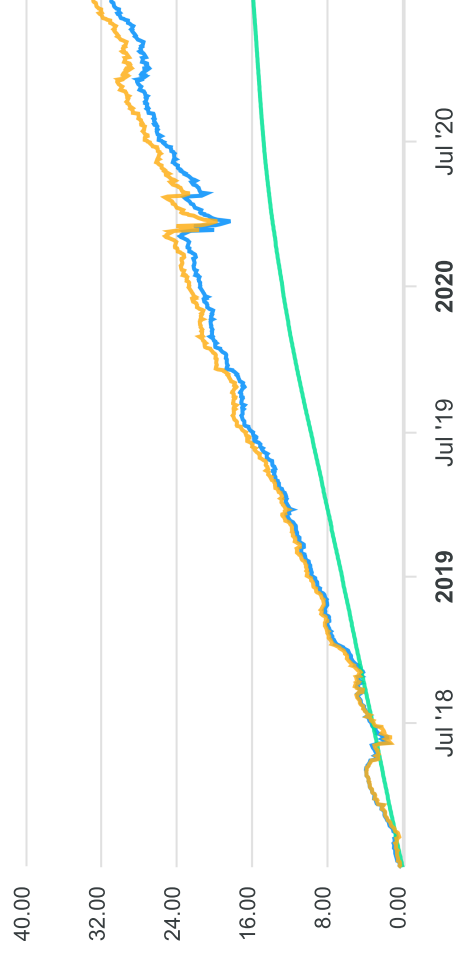
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IDKA IPCA 2 Anos |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços. |

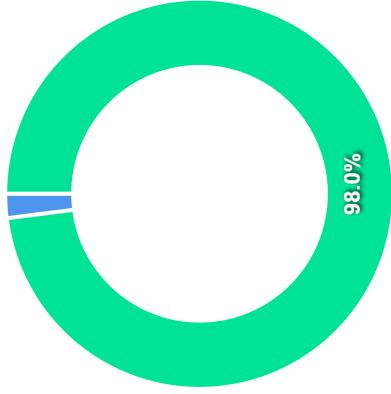
COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,65% | 8,03% | 3,05% | 4,76% | 8,03% | 20,12% | 0,71% | 1,49% |
| Benchmark | 1,73% | 8,62% | 3,05% | 5,10% | 8,62% | 21,46% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 6.142.678,52 | 89,47 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 552.043,77 | 8,04 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024 | 137.430,56 | 2,00 | Operação compromissada |
| LFT - Venc.: 01/09/2023 | 32.203,55 | 0,47 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 1.286,92 | 0,02 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 23,08 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DAPPUTQ24 | -31,55 | 0,00 | Derivativos |
| Outros Valores a pagar | -233,31 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 6.728.212,75 | 98.00% |
| Operação compromissada | 137.430,56 | 2.00% |
| Derivativos | -31,55 | -0.00% |
| Valores a pagar/receber | -209,65 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 976 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 20.761.505.098,56 |

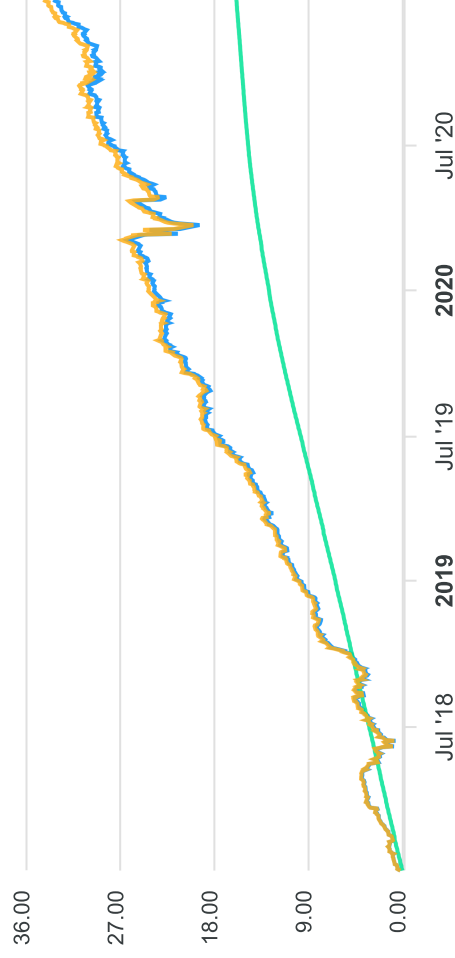
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IMA-B 5 |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5. |

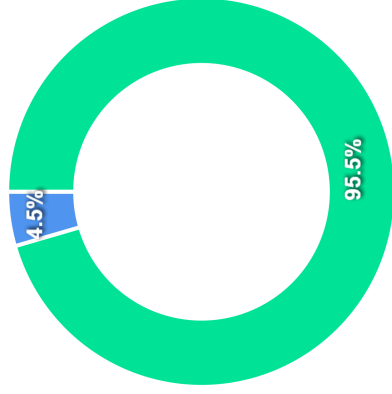
COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,82% | 7,75% | 3,32% | 4,57% | 7,75% | 21,60% | 0,74% | 1,55% |
| Benchmark | 1,83% | 8,04% | 3,38% | 4,72% | 8,04% | 22,25% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 2.150.647,33 | 27,10 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 1.586.454,21 | 19,99 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 1.504.659,55 | 18,96 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 1.433.957,89 | 18,07 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 876.305,80 | 11,04 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024 | 356.651,13 | 4,49 | Operação compromissada |
| LFT - Venc.: 01/03/2023 | 12.881,60 | 0,16 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2026 | 12.840,88 | 0,16 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 1.274,05 | 0,02 | Títulos Federais |
| Outros Valores a receber | 157,49 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23 | 156,90 | 0,00 | Derivativos |
| Outras Disponibilidades | 79,17 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -224,11 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 7.579.021,31 | 95.50% |
| Operação compromissada | 356.651,13 | 4.49% |
| Derivativos | 156,90 | 0.00% |
| Valores a pagar/receber | 12,54 | 0.00% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 322 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.733.830.686,04 |

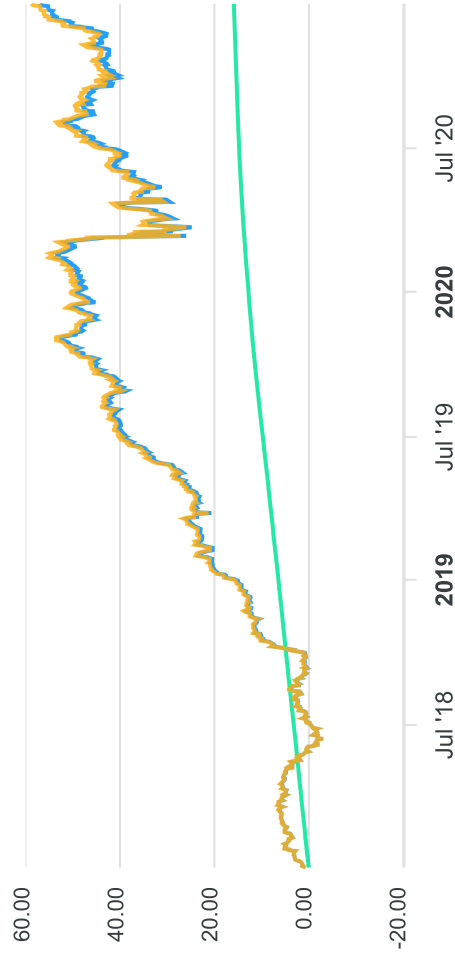
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IMA-B 5+ |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Investe em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços. |

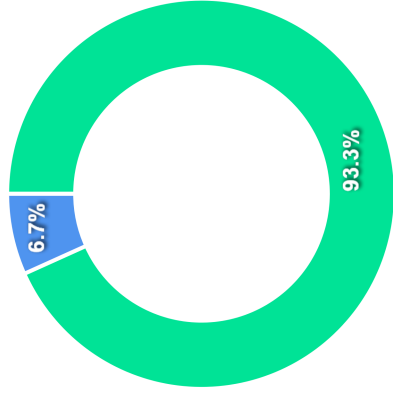
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 7,56% | 5,23% | 10,56% | 11,28% | 5,23% | 36,52% | 3,42% | 7,19% |
| Benchmark | 7,51% | 5,50% | 10,53% | 11,36% | 5,50% | 37,54% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 874.807,65 | 93.30% |
| Operação compromissada | 63.059,95 | 6.73% |
| Derivativos | -133,01 | -0.01% |
| Valores a pagar/receber | -140,22 | -0.01% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 186.050,28 | 19,84 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 142.742,41 | 15,22 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 124.634,30 | 13,29 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 118.926,89 | 12,68 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 92.589,70 | 9,87 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 82.506,17 | 8,80 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024 | 63.059,95 | 6,72 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 42.899,57 | 4,57 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 38.556,30 | 4,11 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 24.792,74 | 2,64 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 20.590,65 | 2,20 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2033 | 518,64 | 0,06 | Títulos Federais |
| Outros Disponibilidades | 46,16 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28 | -133,01 | -0,01 | Derivativos |
| Outros Valores a pagar | -186,96 | -0,02 | Valores a pagar/receber |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 899 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 6.193.173.925,17 |

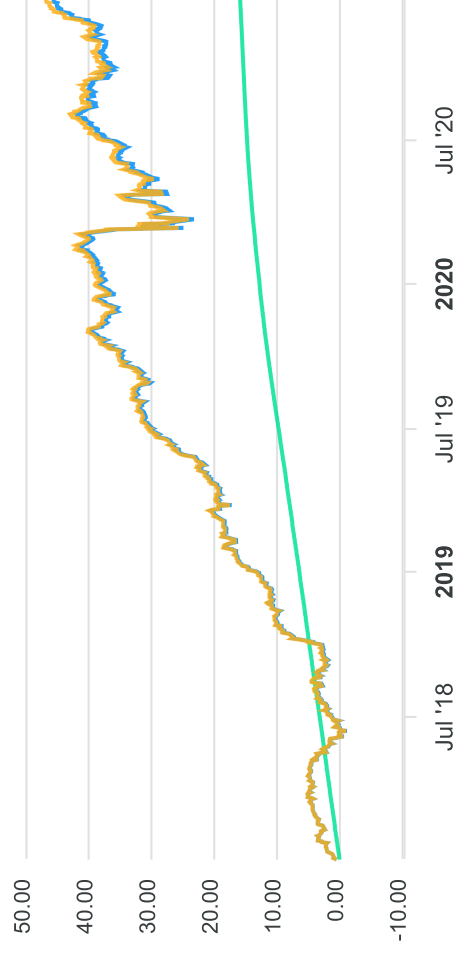
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IMA-B |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B. |

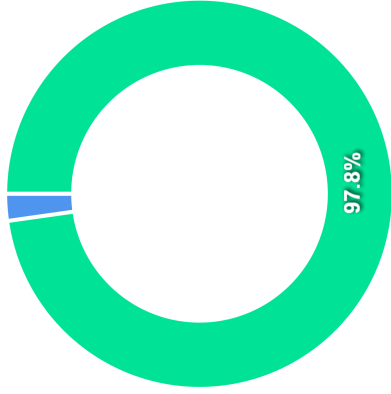
COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 4,84% | 6,06% | 7,13% | 8,09% | 6,06% | 30,02% | 2,04% | 4,29% |
| Benchmark | 4,85% | 6,41% | 7,18% | 8,21% | 6,41% | 30,83% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 427.262,79 | 13,20 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 321.314,00 | 9,93 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 299.850,13 | 9,27 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 297.582,90 | 9,20 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 282.329,65 | 8,72 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 257.866,14 | 7,97 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 230.193,69 | 7,11 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 213.703,13 | 6,60 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 209.950,70 | 6,49 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 186.354,77 | 5,76 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 174.462,88 | 5,39 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 143.094,53 | 4,42 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 75.016,56 | 2,32 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024 | 72.180,21 | 2,23 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 42.999,73 | 1,33 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 1.261,18 | 0,04 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2033 | 872,45 | 0,03 | Títulos Federais |
| Outros Valores a receber | 23,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23 | 22,41 | 0,00 | Derivativos |
| Outras Disponibilidades | 11,16 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -115,21 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 3.164.115,23 | 97,77% |
| Operação compromissada | 72.180,21 | 2,23% |
| Derivativos | 22,41 | 0,00% |
| Valores a pagar/receber | -81,06 | -0,00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 224 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.195.459.257,45 |

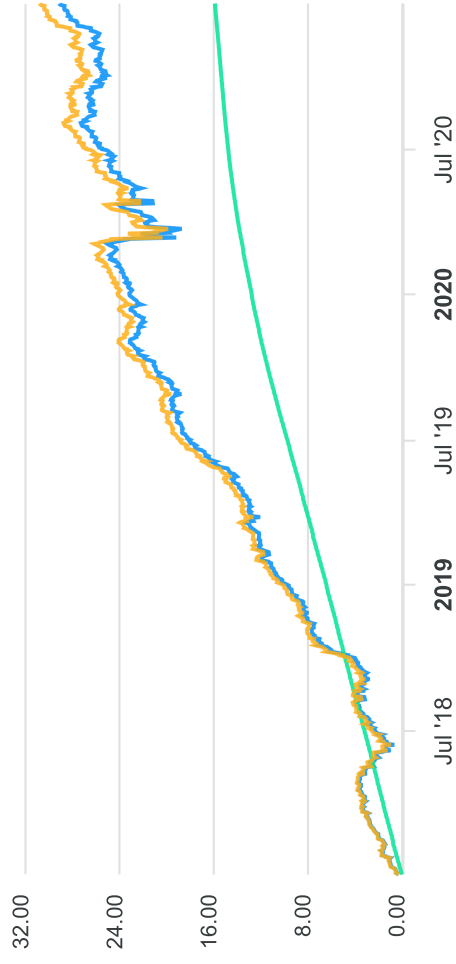
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IMA Geral |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Investe seus recursos em títulos públicos federais em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o Índice IMA Geral. |

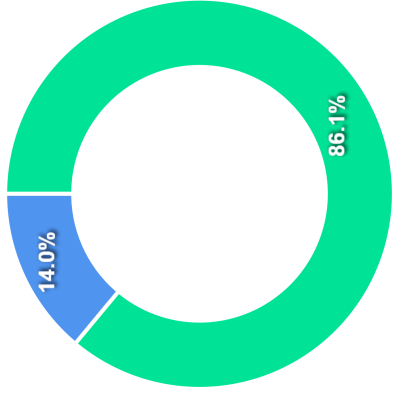
COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 2,11% | 4,82% | 2,85% | 3,16% | 4,82% | 17,74% | 0,89% | 1,88% |
| Benchmark | 2,02% | 5,34% | 2,86% | 3,40% | 5,34% | 18,84% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 411.550,13 | 86,07% |
| Operação compromissada | 66.707,55 | 13,95% |
| Outros | -5,32 | -0,00% |
| Derivativos | -38,41 | -0,01% |
| Valores a pagar/receber | -46,76 | -0,01% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|------------------------|
| LFT - Venc.: 01/09/2027 | 94.079,30 | 19,67 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2026 | 66.707,55 | 13,95 | Operação compromissada |
| LFT - Venc.: 01/03/2025 | 64.391,25 | 13,47 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2024 | 43.847,65 | 9,17 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 19.095,00 | 3,99 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 17.665,77 | 3,69 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 14.532,31 | 3,04 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 13.044,74 | 2,73 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 12.965,04 | 2,71 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2026 | 12.840,88 | 2,69 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 11.842,28 | 2,48 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 10.377,09 | 2,17 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 9.640,07 | 2,02 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 9.630,37 | 2,01 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2025 | 9.131,18 | 1,91 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2027 | 8.716,64 | 1,82 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/01/2026 | 8.508,25 | 1,78 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 7.952,87 | 1,66 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 7.929,19 | 1,66 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 6.461,26 | 1,35 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2029 | 5.394,47 | 1,13 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2025 | 5.297,60 | 1,11 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2024 | 5.102,85 | 1,07 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/01/2025 | 4.011,69 | 0,84 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 3.381,99 | 0,71 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2031 | 2.770,75 | 0,58 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 1.900,69 | 0,40 | Títulos Federais |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 1.361 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 16.753.976.831,37 |

PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IRF-M 1 |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI. |

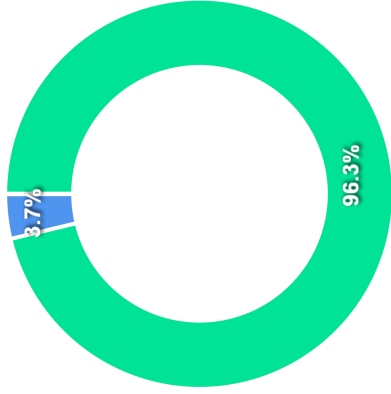
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,28% | 3,63% | 0,64% | 1,12% | 3,63% | 10,42% | 0,10% | 0,21% |
| Benchmark | 0,31% | 3,84% | 0,70% | 1,21% | 3,84% | 10,86% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Operações Compradas - LTN - Venc.: 01/01/2024 | 6.640.420,24 | 96,28 | Operação comprada |
| LFT - Venc.: 01/03/2023 | 176.477,92 | 2,56 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2023 | 77.288,52 | 1,12 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 3.731,33 | 0,05 | Valores a pagar/receber |
| LTN - Venc.: 01/04/2023 | 57,30 | 0,00 | Títulos Federais |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23 | 7,74 | 0,00 | Derivativos |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23 | 1,09 | 0,00 | Derivativos |
| Outros Valores a receber | 0,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut... | -16,68 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24 | -937,11 | -0,01 | Derivativos |
| Outros Valores a pagar | -1.150,44 | -0,02 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Operação comprada | 6.640.420,24 | 96.30% |
| Títulos Federais | 253.823,73 | 3.68% |
| Valores a pagar/receber | 2.581,47 | 0.04% |
| Outros | -16,68 | -0.00% |
| Derivativos | -928,28 | -0.01% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 375 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 2.814.559.159,07 |

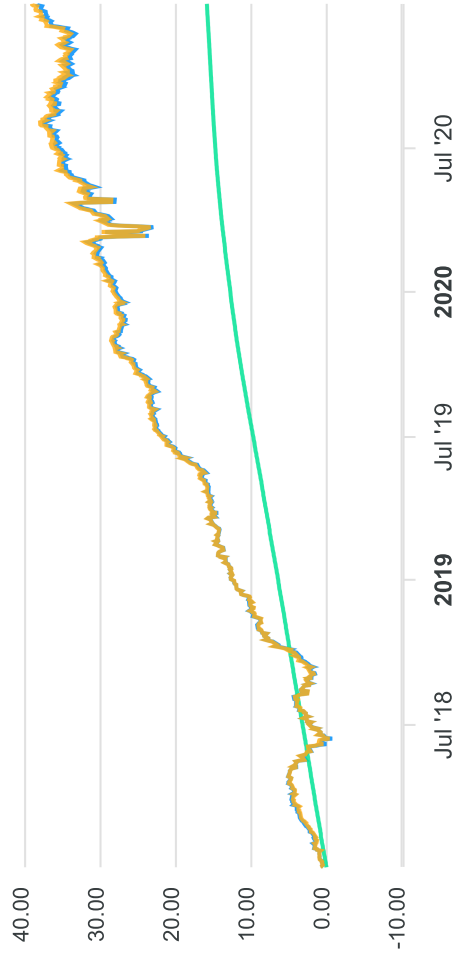
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IRF-M 1+ |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré e/ou pós-fixadas. |

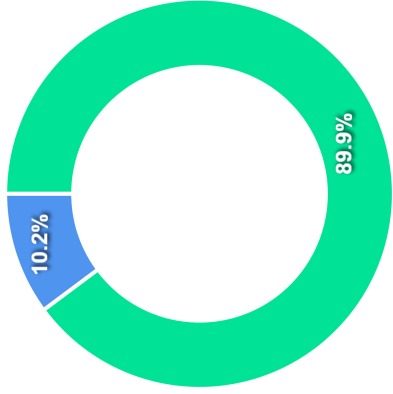
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 3,04% | 8,22% | 2,90% | 2,21% | 8,22% | 23,25% | 1,69% | 3,56% |
| Benchmark | 3,05% | 8,45% | 2,90% | 2,29% | 8,45% | 23,90% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 1.359.696,70 | 89,94% |
| Operação compromissada | 153.822,27 | 10,17% |
| Outros | -110,65 | -0,01% |
| Derivativos | -732,39 | -0,05% |
| Valores a pagar/receber | -853,14 | -0,06% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| LTN - Venc.: 01/01/2026 | 237.521,91 | 15,70 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2025 | 159.684,84 | 10,56 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2024 | 159.082,98 | 10,52 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024 | 153.822,27 | 10,17 | Operação compromissada |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2025 | 119.950,66 | 7,93 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2027 | 118.591,17 | 7,84 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2029 | 105.362,68 | 6,97 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/01/2025 | 73.072,90 | 4,83 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2024 | 67.527,74 | 4,46 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2027 | 63.999,52 | 4,23 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2028 | 63.833,99 | 4,22 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2023 | 57.967,20 | 3,83 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2031 | 46.713,08 | 3,09 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2026 | 38.541,81 | 2,55 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2026 | 26.259,60 | 1,74 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2026 | 19.309,00 | 1,28 | Títulos Federais |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2033 | 2.277,61 | 0,15 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 57,16 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF26 | 6,35 | 0,00 | Derivativos |
| Outros Valores a receber | 0,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25 | -4,94 | 0,00 | Derivativos |
| Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut... | -25,96 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut... | -32,39 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24 | -45,38 | 0,00 | Derivativos |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24 | -47,15 | 0,00 | Derivativos |
| Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut... | -52,30 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31 | -74,85 | 0,00 | Derivativos |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--------------------|
| Administrador | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Gestão | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Taxa de Administração | 0,18% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 69 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 249.647.805,06 |

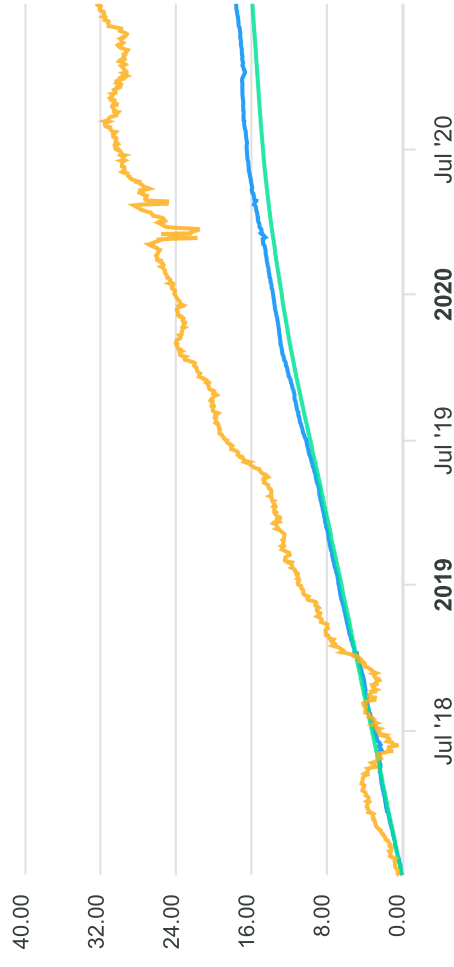
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IRF-M |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Investe em ativos de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à taxa de juros doméstica e/ou índices de preço. |

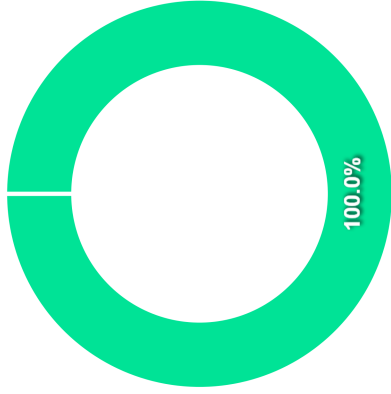
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,34% | 3,48% | 0,65% | 1,00% | 3,48% | 10,23% | 0,10% | 0,21% |
| Benchmark | 1,96% | 6,70% | 1,99% | 1,75% | 6,70% | 19,53% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 230.094,72 | 99,98% |
| Valores a pagar/receber | 42,43 | 0,02% |
| Derivativos | -5,11 | -0,00% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| LTN - Venc.: 01/01/2024 | 102.673,22 | 44,61 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/07/2023 | 76.976,94 | 33,45 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2025 | 22.008,93 | 9,56 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/03/2028 | 20.575,77 | 8,94 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/04/2023 | 4.346,77 | 1,89 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2027 | 2.598,38 | 1,13 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/10/2023 | 463,87 | 0,20 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2023 | 450,85 | 0,20 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 57,58 | 0,03 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 49,22 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições vendidas - D11 | 0,00 | 0,00 | Derivativos |
| LFT - Venc.: 01/03/2024 | 0,00 | 0,00 | Títulos Federais |
| LFT - Venc.: 01/09/2024 | 0,00 | 0,00 | Títulos Federais |
| Mercado Futuro - Posições compradas - D11 | -5,12 | 0,00 | Derivativos |
| Outros Valores a pagar | -64,37 | -0,03 | Valores a pagar/receber |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 301 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 2.989.829.287,39 |

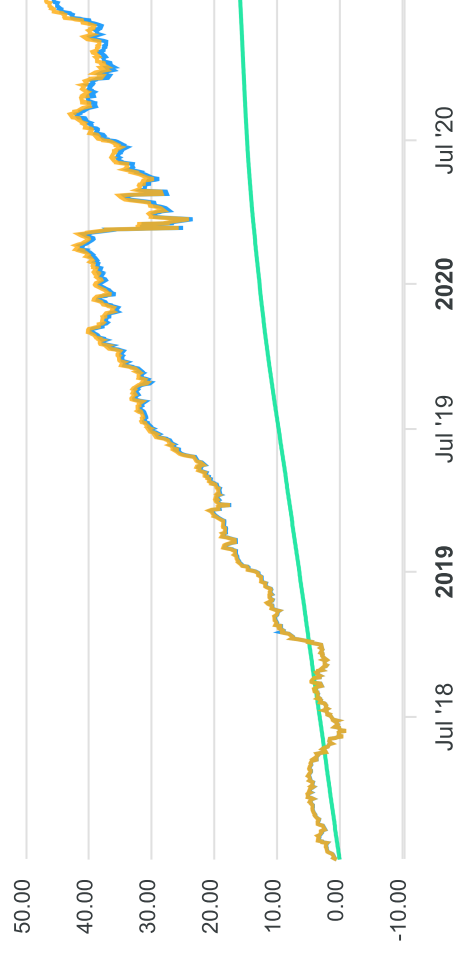
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso III, Alínea A |
| Benchmark | IMA-B |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias. |

COMPARATIVO

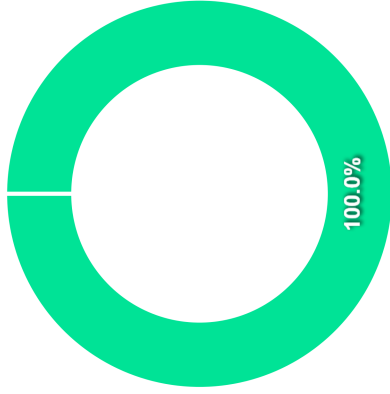
 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 4,85% | 6,05% | 7,10% | 8,06% | 6,05% | 29,87% | 2,04% | 4,29% |
| Benchmark | 4,85% | 6,41% | 7,18% | 8,21% | 6,41% | 30,83% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de CAIXA MASTER BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IM... | 1.235.885,43 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 0,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 0,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -55,25 | 0,00 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 1.235.885,43 | 100,00% |
| Valores a pagar/receber | -54,67 | -0,00% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---------------------------------|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 0,30% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 272 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.391.144.513,85 |

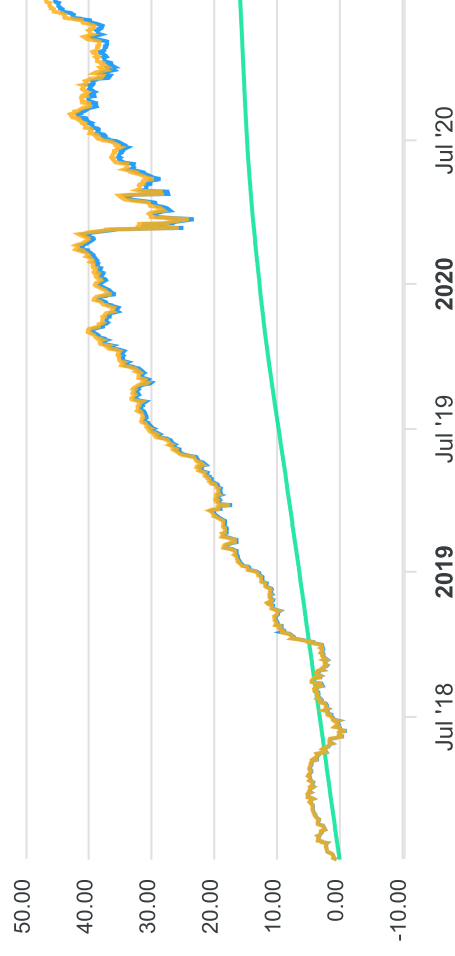
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A |
| Benchmark | IMA-B |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% de seu patrimônio líquido representado por ativos financeiros de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação diária da taxa de juros doméstica e/ou índice de preços. |

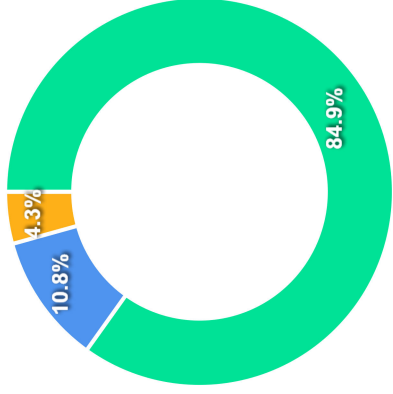
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 4,81% | 5,91% | 7,04% | 8,01% | 5,91% | 29,81% | 2,04% | 4,29% |
| Benchmark | 4,85% | 6,41% | 7,18% | 8,21% | 6,41% | 30,83% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 64.384,09 | 10,81 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 60.654,59 | 10,18 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 50.744,75 | 8,52 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 46.562,80 | 7,82 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 45.049,09 | 7,56 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 43.978,19 | 7,38 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 43.828,23 | 7,36 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 39.743,48 | 6,67 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 39.052,60 | 6,56 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 38.388,23 | 6,44 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 30.925,57 | 5,19 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 25.980,85 | 4,36 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 21.853,73 | 3,67 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 13.925,85 | 2,34 | Títulos Federais |
| Debênture Simples - TAEE33 | 9.234,47 | 1,55 | Debêntures |
| Debênture Simples - ERDV17 | 6.812,87 | 1,14 | Debêntures |
| Debênture Simples - PETR45 | 5.875,39 | 0,99 | Debêntures |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 4.951,69 | 0,83 | Títulos Federais |
| Debênture Simples - CCRDD1 | 2.650,34 | 0,44 | Debêntures |
| Debênture Simples - MOVI37 | 1.008,41 | 0,17 | Debêntures |
| Outras Disponibilidades | 103,95 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 10,15 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 1,91 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -0,41 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -3,96 | 0,00 | Outros |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 505.639,67 | 84.89% |
| Operação compromissada | 64.384,09 | 10.81% |
| Debêntures | 25.581,47 | 4.29% |
| Valores a pagar/receber | 77,82 | 0.01% |
| Outros | -18,46 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---------------------------------|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 576 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 2.596.482.307,62 |

PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A |
| Benchmark | CDI |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento |
| Política de Investimento | Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em cotas de fundo investimento cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

COMPARATIVO

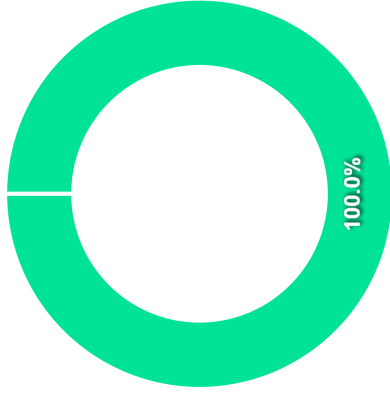
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,25% | 2,40% | 0,57% | 1,01% | 2,40% | 8,28% | 0,02% | 0,04% |
| Benchmark | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 13.891.297,49 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 29,37 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,13 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa | 0,84 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -110,25 | 0,00 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 13.891.297,49 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -66,04 | -0.00% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--|
| Administrador | BANCO BRADESCO S.A. |
| Gestão | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM |
| Taxa de Administração | 0,40% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 196 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.422.915.185,87 |

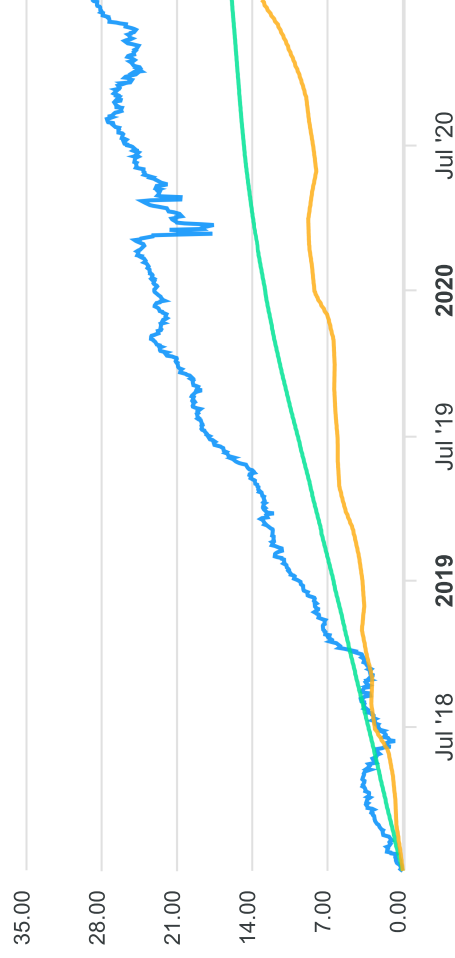
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A |
| Benchmark | IPCA |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de renda fixa, os quais atuam nos mercados de juros pré e pós-fixados e índices de preços, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável. |

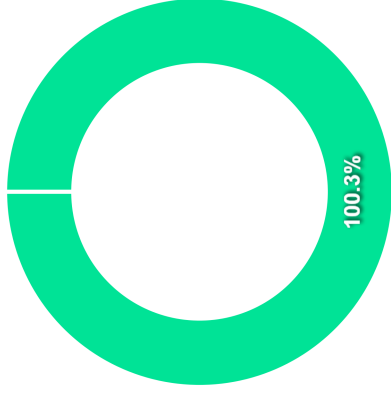
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 2,48% | 4,66% | 3,00% | 2,83% | 4,66% | 17,68% | 1,14% | 2,41% |
| Benchmark | 1,35% | 4,52% | 3,13% | 4,42% | 4,52% | 9,02% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 264.817,56 | 38,68 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA | 228.267,77 | 33,34 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA | 158.841,33 | 23,20 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA | 28.739,91 | 4,20 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA | 2.733,58 | 0,40 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.846,28 | 0,27 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 812,41 | 0,12 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 429,82 | 0,06 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP | 429,15 | 0,06 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 9,53 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,63 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -2.243,44 | -0,33 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 686.917,82 | 100,33% |
| Valores a pagar/receber | -2.233,28 | -0,33% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--|
| Administrador | BANCO BRADESCO S.A. |
| Gestão | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 136 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 954.945.016,55 |

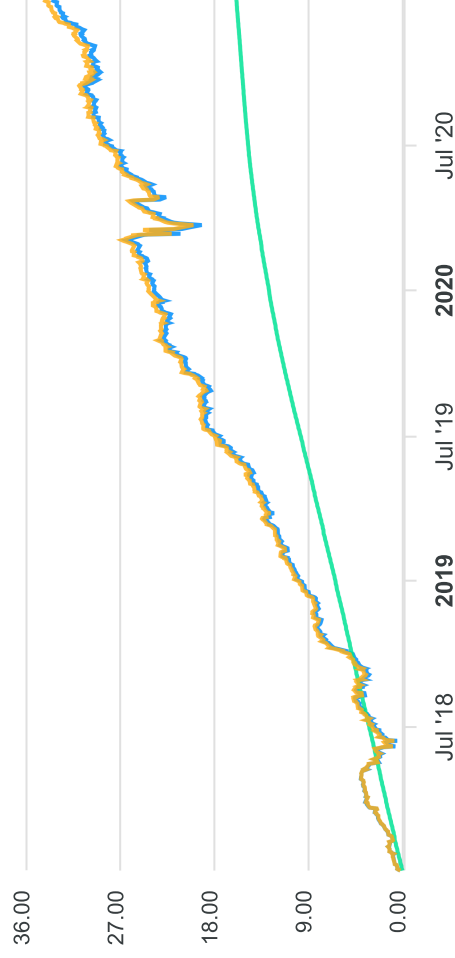
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A |
| Benchmark | IMA-B 5 |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa, que atuam principalmente no mercado de índices de preços. |

COMPARATIVO

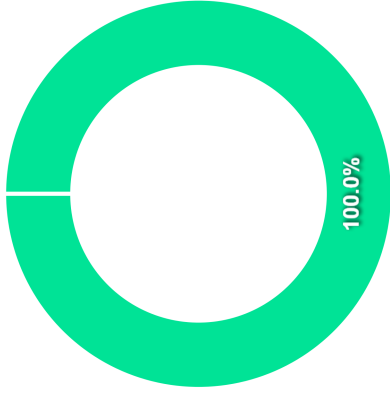
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,78% | 7,86% | 3,23% | 4,48% | 7,86% | 21,79% | 0,77% | 1,62% |
| Benchmark | 1,83% | 8,04% | 3,38% | 4,72% | 8,04% | 22,25% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|-------------------------------------|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 917.643,12 | 100,02 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 10,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,63 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -176,29 | -0,02 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 917.643,12 | 100,02% |
| Valores a pagar/receber | -165,66 | -0,02% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--|
| Administrador | BANCO BRADESCO S.A. |
| Gestão | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 191 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 3.168.557.239,02 |

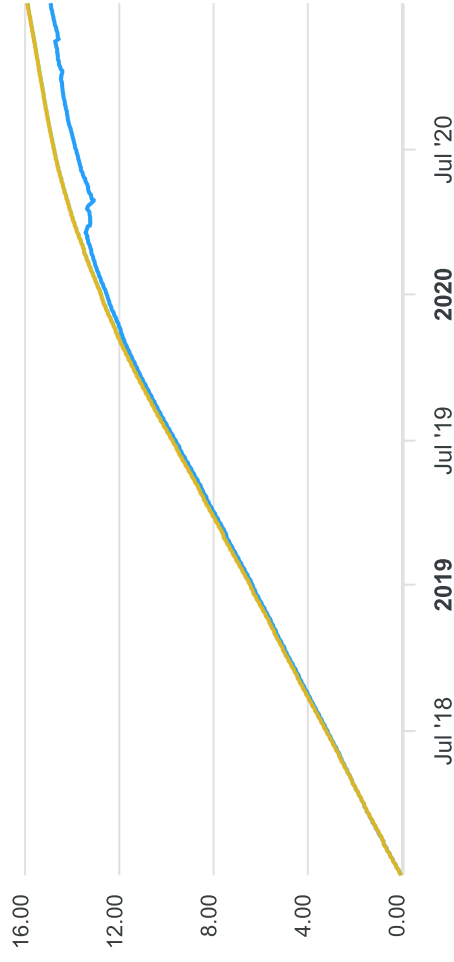
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A |
| Benchmark | Selic |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação do CDI. |

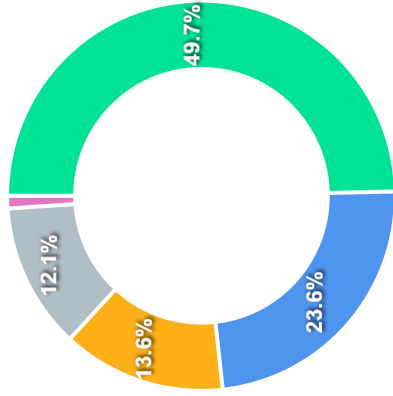
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,22% | 2,13% | 0,41% | 0,96% | 2,13% | 8,09% | 0,02% | 0,05% |
| Benchmark | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Operação compromissada | 4.157.926,61 | 49.67% |
| Títulos Privados | 1.977.096,83 | 23.62% |
| Debêntures | 1.139.969,19 | 13.62% |
| Títulos Federais | 1.012.731,77 | 12.10% |
| Fundos de Investimento | 87.016,29 | 1.04% |
| Derivativos | 53,05 | 0.00% |
| Valores a pagar/receber | -2.873,25 | -0.03% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|------------------------|
| Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025 | 3.862.630,62 | 46,14 | Operação compromissada |
| LFT - Venc.: 01/09/2027 | 338.839,07 | 4,05 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2025 | 295.295,98 | 3,53 | Operação compromissada |
| LFT - Venc.: 01/09/2028 | 265.549,42 | 3,17 | Títulos Federais |
| LTN - Venc.: 01/01/2024 | 209.579,45 | 2,50 | Títulos Federais |
| Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12... | 199.093,49 | 2,38 | Títulos Privados |
| Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/... | 119.468,14 | 1,43 | Títulos Privados |
| Debênture Simples - NCFP14 | 112.663,04 | 1,35 | Debêntures |
| LFT - Venc.: 01/03/2029 | 108.963,34 | 1,30 | Títulos Federais |
| Debênture Simples - ELPLA4 | 102.167,96 | 1,22 | Debêntures |
| Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12... | 91.645,71 | 1,09 | Títulos Privados |
| LFT - Venc.: 01/03/2027 | 83.153,79 | 0,99 | Títulos Federais |
| Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12... | 82.150,29 | 0,98 | Títulos Privados |
| Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888... | 81.888,03 | 0,98 | Títulos Privados |
| CDB/ RDB - BANCO PAN S.A. (59.285.411/0001-13) - Venc.: 29... | 63.398,96 | 0,76 | Títulos Privados |
| Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12... | 57.520,11 | 0,69 | Títulos Privados |
| Debênture Simples - CIEL16 | 51.356,25 | 0,61 | Debêntures |
| Debênture Simples - PALFA2 | 46.539,99 | 0,56 | Debêntures |
| Debênture Simples - ASA14 | 46.408,68 | 0,55 | Debêntures |
| Debêntures - CELG DISTRIBUIÇÃO S.A. (01.543.032/0001-04) - ... | 46.286,35 | 0,55 | Debêntures |
| Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12... | 45.266,88 | 0,54 | Títulos Privados |
| Debênture Simples - EQTL55 | 42.908,82 | 0,51 | Debêntures |
| Letra Financeira - BANCO BBM S.A. (15.114.366/0001-69) - V... | 41.793,63 | 0,50 | Títulos Privados |
| Letra Financeira - BANCO SICREDI S.A. (01.181.521/0001-55)... | 40.762,76 | 0,49 | Títulos Privados |
| Debênture Simples - ANHBA3 | 40.093,67 | 0,48 | Debêntures |
| Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12... | 36.800,27 | 0,44 | Títulos Privados |
| Debênture Simples - LORTA9 | 35.620,33 | 0,43 | Debêntures |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--------------------|
| Administrador | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Gestão | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Taxa de Administração | 0,40% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 269 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 3.882.685.363,64 |

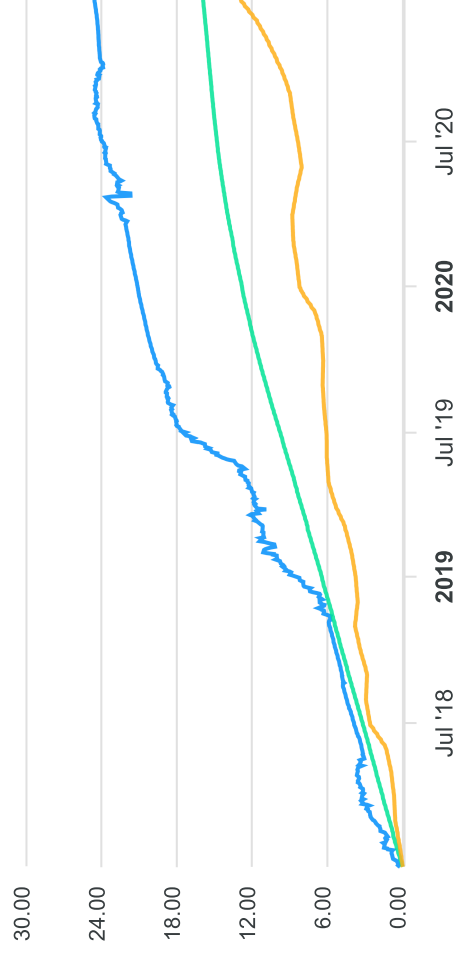
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A |
| Benchmark | IPCA |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre |
| Política de Investimento | Alocar preponderante em cotas de fundos de investimento de renda fixa atrelados ao IMA e seus sub-índices, podendo alocar também em fundos de investimento de renda fixa que seguem o CDI. |

COMPARATIVO

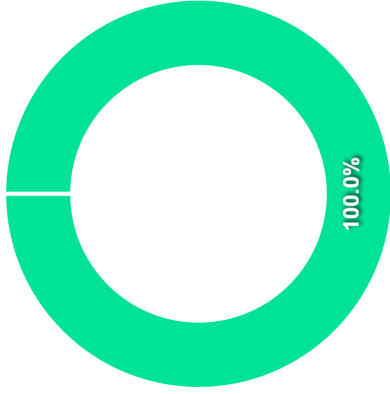
 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,20% | 2,86% | 0,38% | 0,58% | 2,86% | 15,12% | 0,02% | 0,04% |
| Benchmark | 1,35% | 4,52% | 3,13% | 4,42% | 4,52% | 9,02% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | 2.177.696,89 | 99,83 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 4.336,00 | 0,20 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 70,82 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 48,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -694,63 | -0,03 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 2.182.032,89 | 100,03% |
| Valores a pagar/receber | -575,45 | -0,03% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---------------------------------|
| Administrador | INTRAG DTVM LTDA |
| Gestão | XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA. |
| Taxa de Administração | 0,50% |
| Taxa de Performance | 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 du ou D+5 du |
| Quantidade de Cotistas | 15.650 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 632.876.961,39 |

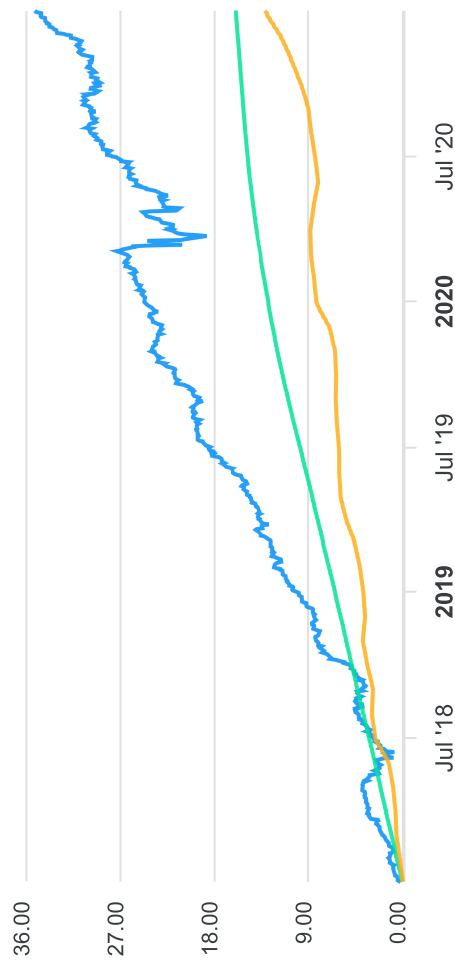
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A |
| Benchmark | IPCA |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos, principalmente, em títulos públicos, títulos privados e outros ativos atrelados a juros que acompanhem direta ou indiretamente o índice de IPCA. |

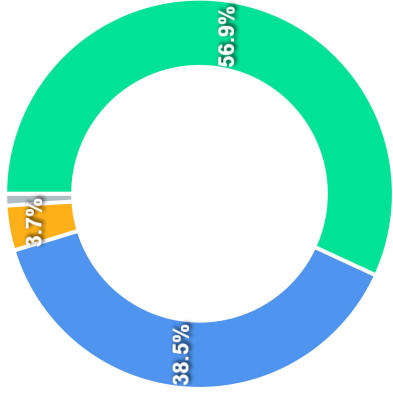
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 2,62% | 8,40% | 4,47% | 6,15% | 8,40% | 23,04% | 0,99% | 2,09% |
| Benchmark | 1,35% | 4,52% | 3,13% | 4,42% | 4,52% | 9,02% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 121.284,49 | 20,19 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 79.299,16 | 13,20 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 60.901,22 | 10,14 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 40.157,07 | 6,68 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 20.346,51 | 3,39 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 19.993,18 | 3,33 | Títulos Federais |
| Debênture Simples - GRRB24 | 19.057,11 | 3,17 | Debêntures |
| Debênture Simples - SBSPC2 | 17.047,28 | 2,84 | Debêntures |
| Debênture Simples - GEPA28 | 10.594,50 | 1,76 | Debêntures |
| Debênture Simples - OMGE31 | 10.489,37 | 1,75 | Debêntures |
| Debênture Simples - LIGHD7 | 10.470,12 | 1,74 | Debêntures |
| Debênture Simples - LORTA7 | 10.250,28 | 1,71 | Debêntures |
| Debênture Simples - VAMOC33 | 10.230,97 | 1,70 | Debêntures |
| Debênture Simples - UNDAB2 | 9.221,99 | 1,54 | Debêntures |
| Debênture Simples - LCAAMD1 | 9.093,47 | 1,51 | Debêntures |
| Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12... | 7.382,48 | 1,23 | Títulos Privados |
| Debênture Simples - CSAN33 | 6.931,36 | 1,15 | Debêntures |
| Debênture Simples - ERDV17 | 6.860,24 | 1,14 | Debêntures |
| Debênture Simples - BTOW15 | 6.738,94 | 1,12 | Debêntures |
| Debênture Simples - TAEE33 | 6.720,13 | 1,12 | Debêntures |
| Debênture Simples - BRFS31 | 6.630,40 | 1,10 | Debêntures |
| Debênture Simples - STEN23 | 6.439,85 | 1,07 | Debêntures |
| Debênture Simples - CART13 | 6.438,62 | 1,07 | Debêntures |
| Debênture Simples - PETR45 | 6.173,35 | 1,03 | Debêntures |
| Debênture Simples - UTPS21 | 5.992,16 | 1,00 | Debêntures |
| Cotas de SANTANDER CASH BLACK FI RENDA FIXA REFERENCIADO D... | 5.827,86 | 0,97 | Fundos de Investimento |
| Debênture Simples - MTRJ19 | 5.383,74 | 0,90 | Debêntures |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 341.981,63 | 56.93% |
| Debêntures | 231.096,05 | 38.47% |
| Títulos Privados | 22.446,08 | 3.74% |
| Fundos de Investimento | 5.827,86 | 0.97% |
| Valores a pagar/receber | -628,09 | -0.10% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,20% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+0 |
| Quantidade de Cotistas | 76 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 199.070.839,42 |

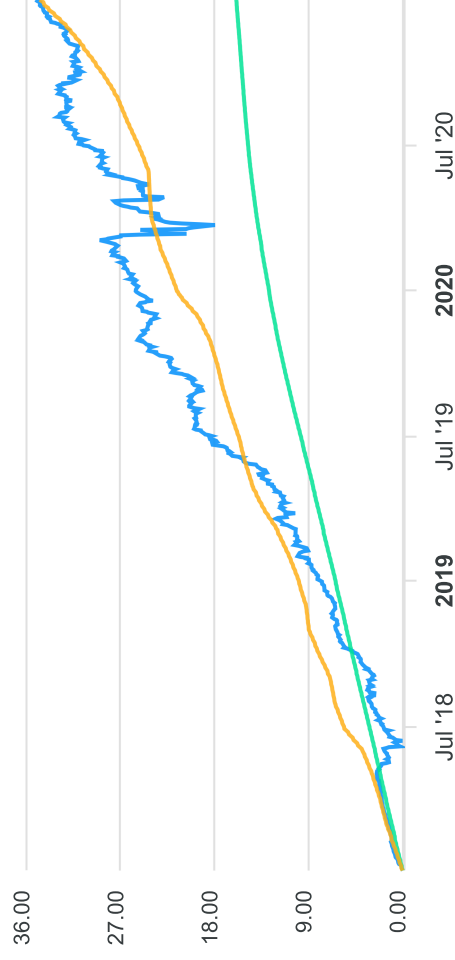
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea B |
| Benchmark | IPCA + 6,00% ao ano |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em ativos financeiros expostos diretamente ao risco das variações das taxas de juros pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). |

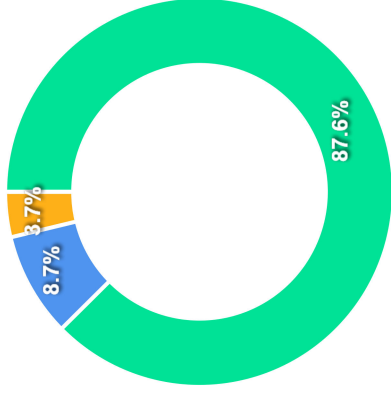
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,78% | 7,59% | 2,87% | 3,90% | 7,59% | 25,32% | 0,71% | 1,49% |
| Benchmark | 1,87% | 10,76% | 4,65% | 7,55% | 10,76% | 22,49% | | |
| CDI | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 56.293,84 | 24,54 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 43.100,46 | 18,79 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 41.135,19 | 17,93 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 35.244,91 | 15,36 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 25.160,66 | 10,97 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2024 | 8.571,35 | 3,74 | Operação compromissada |
| Letra Financeira - PARANÁ BANCO S.A. (14.388.334/0001-99) ... | 7.326,91 | 3,19 | Títulos Privados |
| DPGE - HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL S.A. (34.111.187/... | 7.210,14 | 3,14 | Títulos Privados |
| Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-03) - Ve... | 5.321,44 | 2,32 | Títulos Privados |
| Outras Disponibilidades | 55,71 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,41 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -21,44 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 200.935,06 | 87.59% |
| Títulos Privados | 19.858,49 | 8.66% |
| Operação compromissada | 8.571,35 | 3.74% |
| Valores a pagar/receber | 34,69 | 0.02% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---------------------------------|
| Administrador | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão | BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração | 1,50% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 4.397 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 218.923.792,06 |

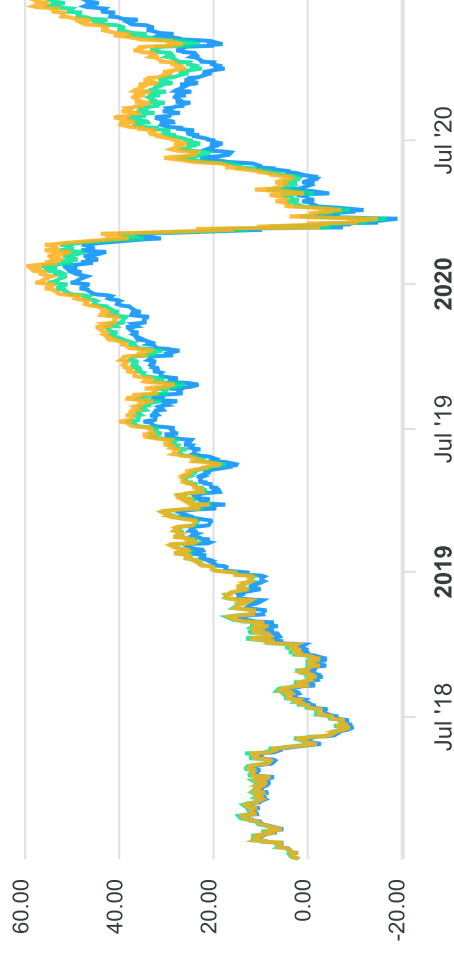
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso I, Alínea A |
| Benchmark | IBX |
| Classificação ANBIMA | Ações Indexados |
| Política de Investimento | Procura investir no mercado acionário através de uma carteira diversificada de ações negociadas na Bovespa, com intuito de compor uma carteira de ativos que reflita o comportamento da carteira teórica do IBX. |

COMPARATIVO

31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 9,04% | 1,17% | 24,83% | 24,05% | 1,17% | 31,65% | 6,92% | 14,57% |
| Benchmark | 9,15% | 3,50% | 25,34% | 25,28% | 3,50% | 38,06% | | |
| IBOVESPA | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---------------|-----------------|---------------|------------|
|---------------|-----------------|---------------|------------|

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------|-----------------|---------------|
|-------|-----------------|---------------|

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---|
| Administrador | BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA |
| Gestão | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM |
| Taxa de Administração | 1,50% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 1.847 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.837.636.759,23 |

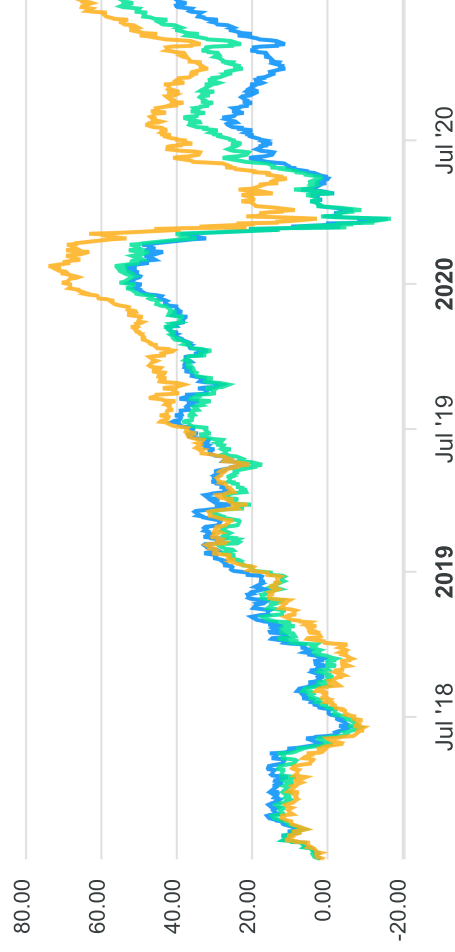
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso II, Alínea A |
| Benchmark | IDIV |
| Classificação ANBIMA | Ações Dividendos |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em ações de empresas com consistente histórico e perspectivas de recebimento de dividendos. |

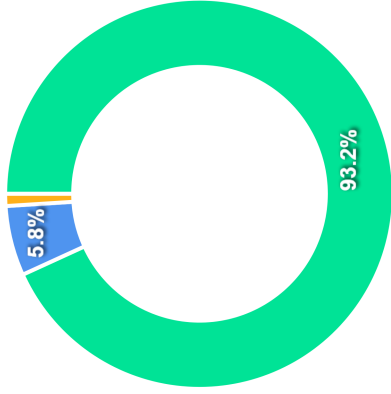
COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 9,43% | -5,65% | 25,79% | 21,37% | -5,65% | 16,62% | 6,90% | 14,54% |
| Benchmark | 8,94% | -1,00% | 25,44% | 21,29% | -1,00% | 43,71% | | |
| IBOVESPA | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Ações | 540.988,45 | 93,19% |
| Operação compromissada | 33.683,13 | 5,80% |
| Valores a pagar/receber | 5.829,89 | 1,00% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|------------------------|
| VALE ON N1 - VALE3 | 54.560,83 | 9,40 | Ações |
| PETROBRAS PN - PETR4 | 50.495,70 | 8,70 | Ações |
| ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4 | 38.284,08 | 6,60 | Ações |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2025 | 33.683,13 | 5,80 | Operação compromissada |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3 | 22.298,72 | 3,84 | Ações |
| BRDESCO PN N1 - BBDC4 | 21.653,12 | 3,73 | Ações |
| SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3 | 19.409,27 | 3,34 | Ações |
| B3 ON NM - B3SA3 | 18.867,25 | 3,25 | Ações |
| GERDAU MET PN N1 - GOAU4 | 16.511,60 | 2,84 | Ações |
| BRASIL ON NM - BBAS3 | 16.394,04 | 2,82 | Ações |
| BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3 | 16.191,59 | 2,79 | Ações |
| WEG ON NM - WEGE3 | 15.060,11 | 2,59 | Ações |
| SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3 | 13.652,82 | 2,35 | Ações |
| MINERVA ON NM - BEEF3 | 13.651,52 | 2,35 | Ações |
| ITAUSA PN N1 - ITSA4 | 13.628,35 | 2,35 | Ações |
| AMBEV S/A ON - ABEV3 | 13.608,42 | 2,34 | Ações |
| LOCALIZA ON NM - RENT3 | 12.849,93 | 2,21 | Ações |
| ELETROBRAS ON N1 - ELET3 | 12.360,49 | 2,13 | Ações |
| AUREN ON NM - AURE3 | 10.963,90 | 1,89 | Ações |
| SABESP ON NM - SBSP3 | 10.771,56 | 1,86 | Ações |
| SAO MARTINHO ON NM - SMTO3 | 10.686,88 | 1,84 | Ações |
| PETRORECSA ON NM - RECV3 | 10.380,44 | 1,79 | Ações |
| REDE D OR ON NM - RDOR3 | 10.181,14 | 1,75 | Ações |
| LOJAS RENNER ON NM - LREN3 | 9.410,70 | 1,62 | Ações |
| BTGP BANCO UNT - BPAC11 | 8.315,35 | 1,43 | Ações |
| AREZZO CO ON NM - ARZZ3 | 8.150,50 | 1,40 | Ações |
| ULTRAPAR ON NM - UGPA3 | 8.112,29 | 1,40 | Ações |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---|
| Administrador | BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA |
| Gestão | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM |
| Taxa de Administração | 1,50% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 202 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 831.343.765,94 |

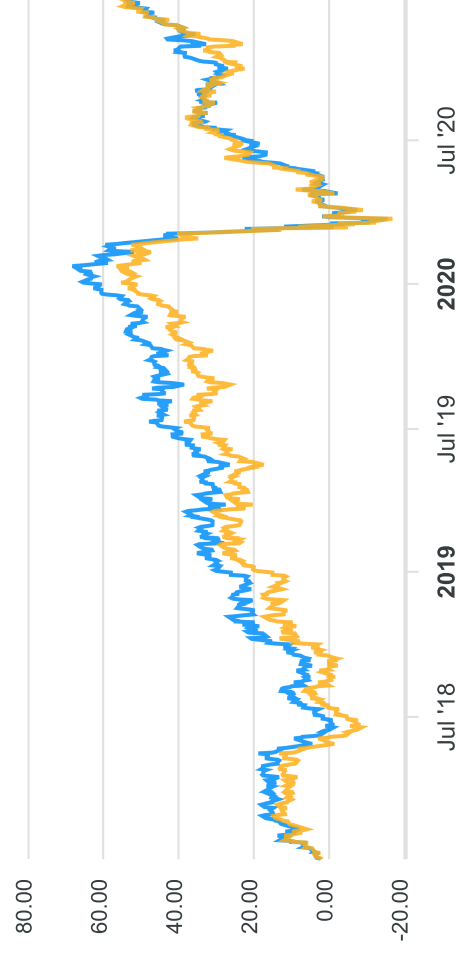
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso II, Alínea A |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Índice Ativo |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 67% dos seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de Fundos de ações e cotas dos Fundos de Índice de ações. O fundo não pode conter mais de 20 empresas emissoras de ações. |

COMPARATIVO

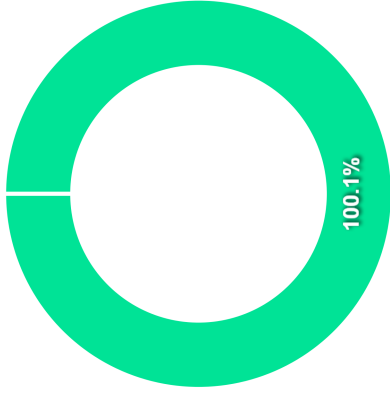
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 7,90% | -3,67% | 20,63% | 27,64% | -3,67% | 22,88% | 6,96% | 14,65% |
| Benchmark | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--------------------------------------|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BRAM INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 420.742,16 | 100,12 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 2.959,22 | 0,70 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 10,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -3.479,16 | -0,83 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 420.742,16 | 100,12% |
| Valores a pagar/receber | -509,94 | -0,12% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--------------------|
| Administrador | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Gestão | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Taxa de Administração | 1,90% |
| Taxa de Performance | 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate | D+24 |
| Quantidade de Cotistas | 42.737 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 3.595.641.284,57 |
| Patrimônio Líquido Master | 4.359.163.323,49 |

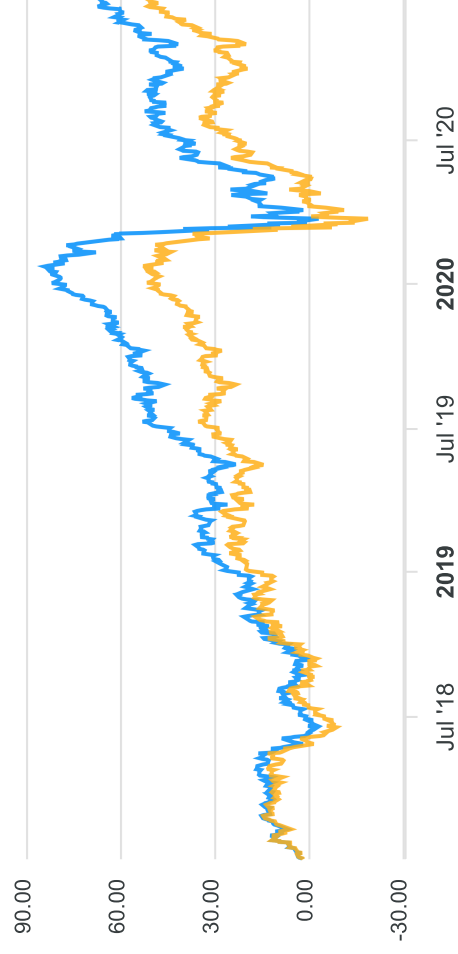
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso II, Alínea A |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Livre |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 18.138.837/0001-67. |

COMPARATIVO

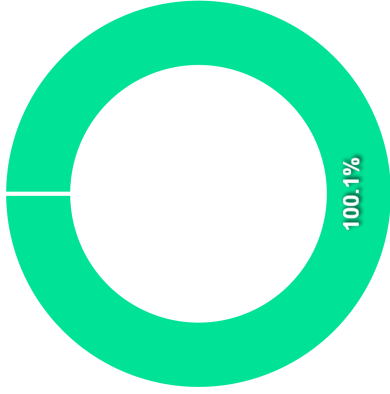
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 6,30% | -4,87% | 19,94% | 22,34% | -4,87% | 38,19% | 6,12% | 12,90% |
| Benchmark | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER FIC AÇÕES | 1.684.310,22 | 99,83 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ CAIXA FIC AÇÕES | 4.295,31 | 0,25 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 4.033,01 | 0,24 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 70,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -5.587,67 | -0,33 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 1.688.605,53 | 100,09% |
| Valores a pagar/receber | -1.484,66 | -0,09% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--------------------|
| Administrador | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Gestão | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Taxa de Administração | 2,50% |
| Taxa de Performance | 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate | D+24 |
| Quantidade de Cotistas | 138 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.462.115.658,31 |
| Patrimônio Líquido Master | 1.875.685.360,54 |

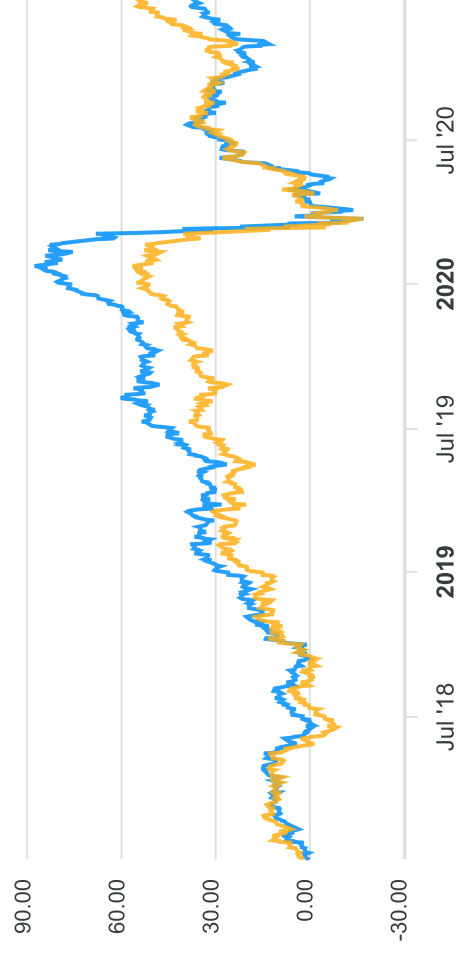
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso II, Alínea A |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Livre |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES, CNPJ: 09.094.073/0001-64. |

COMPARATIVO

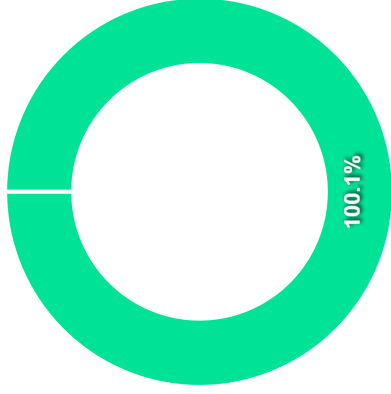
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|---------|--------|--------|---------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 7,97% | -21,23% | 17,87% | 10,19% | -21,23% | 10,15% | 6,55% | 13,79% |
| Benchmark | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---------------------------------|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de ITAÚ PHOENIX FIC AÇÕES | 357.700,07 | 99,91 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ CAIXA FIC AÇÕES | 819,90 | 0,23 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 70,92 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 34,49 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -600,18 | -0,17 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 358.519,97 | 100,14% |
| Valores a pagar/receber | -494,77 | -0,14% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|----------------------------|
| Administrador | INTRAG DTVM LTDA |
| Gestão | XP GESTAO DE RECURSOS LTDA |
| Taxa de Administração | 2,00% |
| Taxa de Performance | 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate | D+33 |
| Quantidade de Cotistas | 3.502 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 589.693.431,87 |
| Patrimônio Líquido Master | 669.620.221,50 |

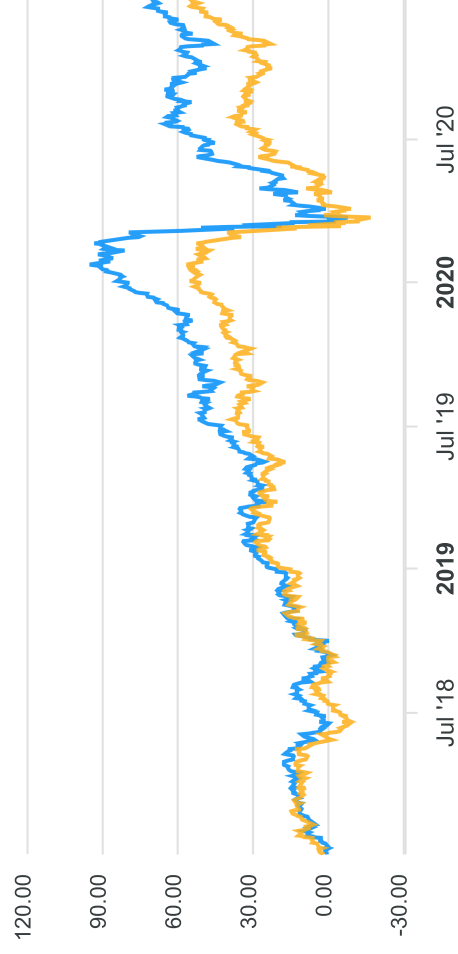
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso II, Alínea A |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Livre |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do XP INVESTOR 30 MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 26.776.803/0001-26. |

COMPARATIVO

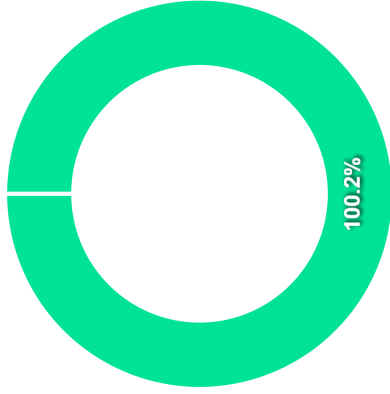
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 6,83% | -5,21% | 13,16% | 15,19% | -5,21% | 41,54% | 6,55% | 13,79% |
| Benchmark | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de XP INVESTOR 30 MASTER FIAÇÕES | 223.339,58 | 98,64 | Fundos de Investimento |
| Cotas de SANTANDER CASH BLACK FI RENDA FIXA REFERENCIADO D... | 3.589,02 | 1,59 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 12,56 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 2,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -523,34 | -0,23 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 226.928,60 | 100,22% |
| Valores a pagar/receber | -508,78 | -0,22% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|----------------------------|
| Administrador | INTRAG DTVM LTDA |
| Gestão | XP GESTAO DE RECURSOS LTDA |
| Taxa de Administração | 3,00% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+33 |
| Quantidade de Cotistas | 1.797 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 249.045.827,24 |
| Patrimônio Líquido Master | 243.912.947,40 |

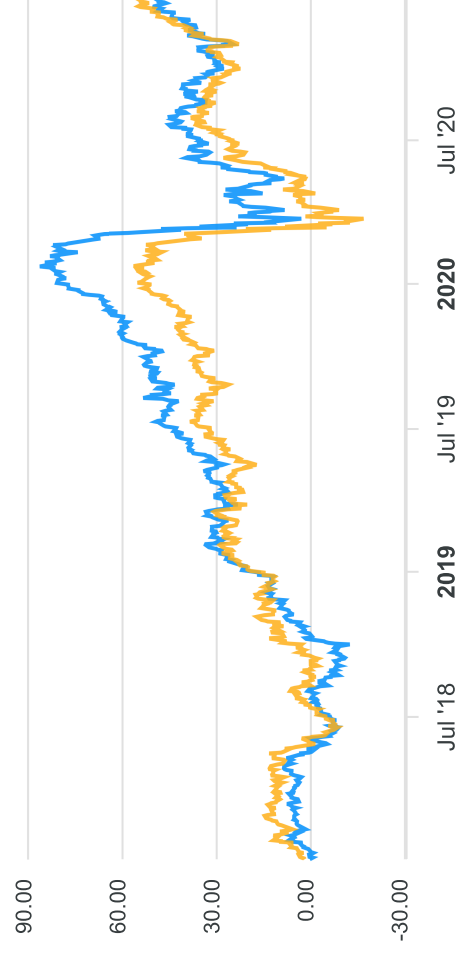
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso II, Alínea A |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Livre |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 MASTER FIAÇÕES, CNPJ: 26.773.141/0001-30. |

COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|---------|--------|--------|---------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 8,07% | -15,62% | 16,10% | 11,25% | -15,62% | 28,39% | 7,91% | 16,66% |
| Benchmark | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---------------|-----------------|---------------|------------|
|---------------|-----------------|---------------|------------|

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------|-----------------|---------------|
|-------|-----------------|---------------|


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--------------------|
| Administrador | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Gestão | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Taxa de Administração | 0,35% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 30 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 71.591.349,17 |

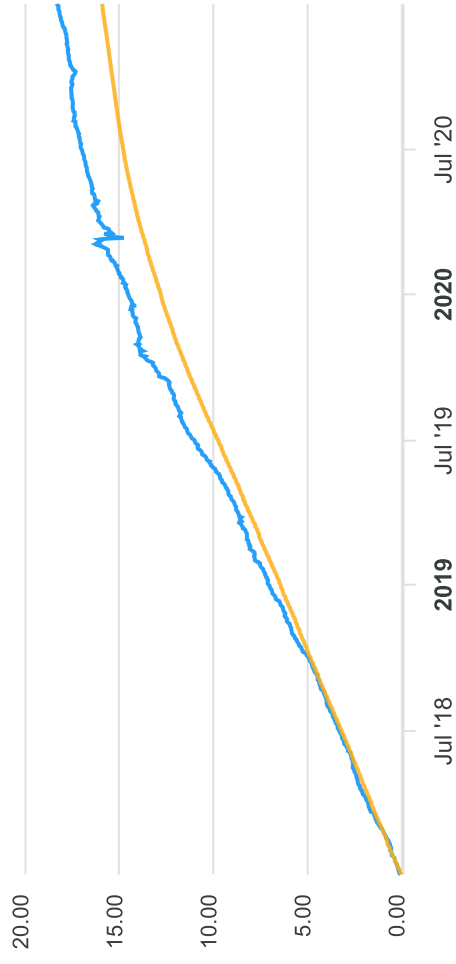
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso III |
| Benchmark | CDI |
| Classificação ANBIMA | Multimercados Juros e Moedas |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em cotas de fundo de investimentos de ativos de renda fixa de diferentes naturezas e características, admitindo-se estratégias que impliquem risco de juros, índice de preço e moeda estrangeira. |

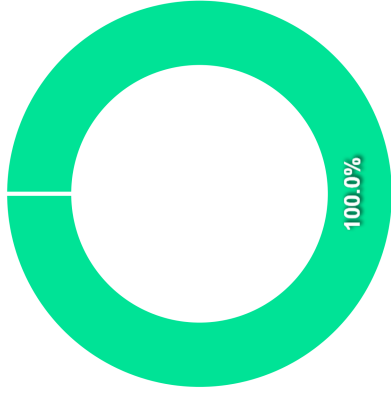
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,35% | 3,30% | 0,69% | 1,14% | 3,30% | 10,52% | 0,11% | 0,22% |
| Benchmark | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |
| IBOVESPA | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de ITAÚ VERSO P FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 30.357,90 | 40,39 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ VERSO E FX FI MULTIMERCADO | 12.029,34 | 16,00 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ UNIBANCO FIDELIDADE W3 FI RENDA FIXA | 9.104,04 | 12,11 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 8.013,36 | 10,66 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ FIDELIDADE T FI RENDA FIXA | 6.768,07 | 9,00 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ VERSO JM FI MULTIMERCADO | 5.931,62 | 7,89 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ JUROS OCEAN FI RENDA FIXA | 2.971,31 | 3,95 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 30,00 | 0,04 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 17,34 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -59,71 | -0,08 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 75.175,65 | 100,02% |
| Valores a pagar/receber | -12,37 | -0,02% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--------------------|
| Administrador | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Gestão | ITAÚ UNIBANCO S.A. |
| Taxa de Administração | 1,00% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 |
| Quantidade de Cotistas | 1.041 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.995.120.518,18 |

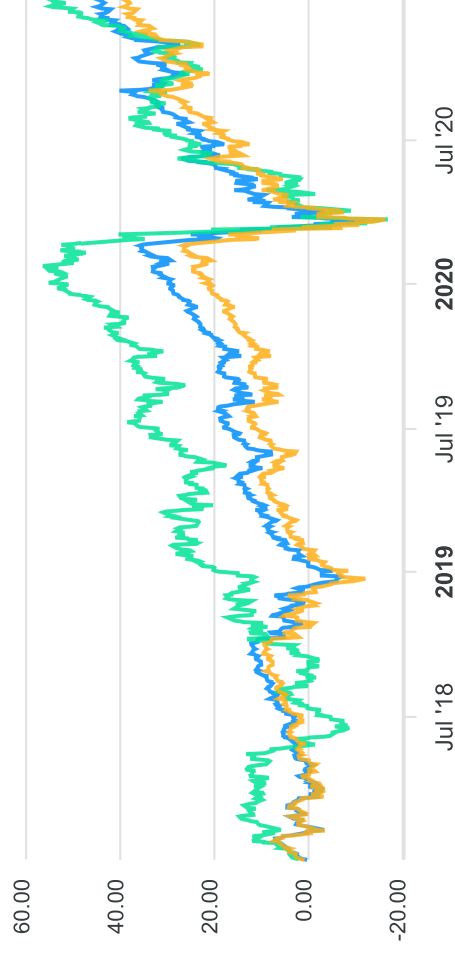
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso III |
| Benchmark | S&P 500 (Moeda Original) |
| Classificação ANBIMA | Multimercados Estratégia Específica |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem, principalmente, em ativos que tenham como principal fator de risco a variação do preço do índice S&P 500. |

COMPARATIVO

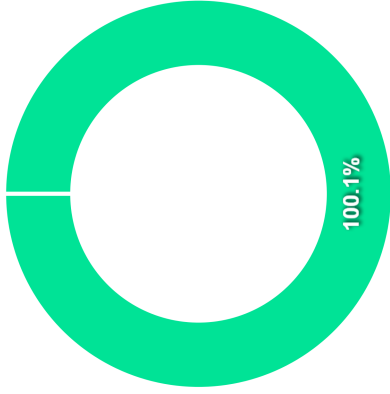
📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 3,06% | 12,93% | 11,36% | 20,06% | 12,93% | 49,53% | 4,46% | 9,39% |
| Benchmark | 3,71% | 16,26% | 11,69% | 21,15% | 16,26% | 49,83% | | |
| IBOVESPA | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de ITAÚ INDEX S&P500® FI MULTIMERCADO | 1.134.556,08 | 99,53 | Fundos de Investimento |
| Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 5.943,39 | 0,52 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 2.882,76 | 0,25 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 70,00 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -3.578,52 | -0,31 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 1.140.499,47 | 100,05% |
| Valores a pagar/receber | -625,76 | -0,05% |

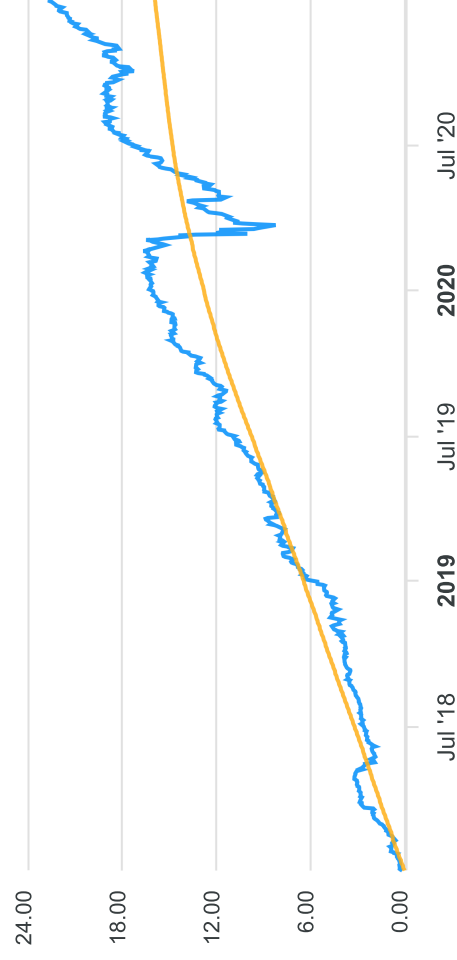
PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|--|
| Administrador | BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S/A |
| Gestão | XP GESTAO DE RECURSOS LTDA |
| Taxa de Administração | 1,25% |
| Taxa de Performance | 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate | D+1 du |
| Quantidade de Cotistas | 11.031 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 428.489.928,37 |
| PERFIL DO FUNDO | |
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso III |
| Benchmark | CDI |
| Classificação ANBIMA | Multimercados Macro |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do XP MACRO INSTITUCIONAL MASTER FI MULTIMERCADO, CNPJ: 26.541.175/0001-08. |

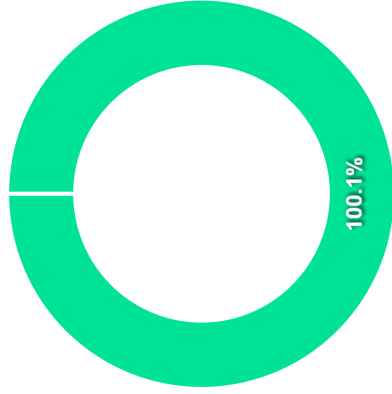
COMPARATIVO

📅 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,48% | 5,68% | 3,93% | 4,73% | 5,68% | 16,13% | -% | -% |
| Benchmark | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | | |
| IBOVESPA | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de XP MACRO INSTITUCIONAL MASTER FI MULTIMERCADO | 179.735,97 | 97,98 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 564,83 | 0,31 | Valores a pagar/receber |
| Cotas de XP CASH VIII FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH VII FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH VI FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH X FI RENDA FIXA SIMPLES I | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH IX FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH V FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH II FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH IV FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH III FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Cotas de XP CASH I FI RENDA FIXA SIMPLES | 388,42 | 0,21 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 1,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -741,63 | -0,40 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 183.620,17 | 100.10% |
| Valores a pagar/receber | -175,79 | -0.10% |


PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Administrador | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Gestão | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| Taxa de Administração | 0,70% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 191 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 1.987.917.698,76 |

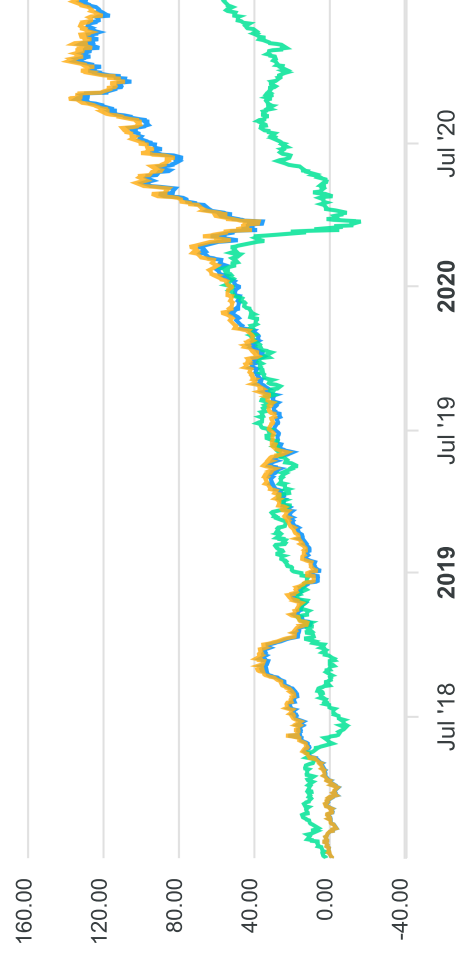
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 9º - A, Inciso III |
| Benchmark | Global BDRX |
| Classificação ANBIMA | Ações Livre |
| Política de Investimento | Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais. |

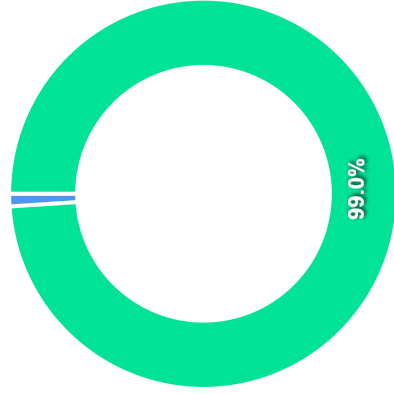
COMPARATIVO

 31/12/2020

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|--------|--------|--------|---------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,69% | 54,76% | 1,31% | 16,49% | 54,76% | 108,09% | 7,07% | 14,89% |
| Benchmark | 0,93% | 54,01% | 1,70% | 16,29% | 54,01% | 108,94% | | |
| IBOVESPA | 9,30% | 2,92% | 25,81% | 25,21% | 2,92% | 35,42% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------------|-----------------|---------------|
| Brazilian Depository Receipts | 1.963.054,31 | 98,96% |
| Fundos de Investimento | 20.388,25 | 1,03% |
| Valores a pagar/receber | 164,62 | 0,01% |
| Outros | 0,00 | 0,00% |

| Nome do Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|------------------------------|
| Brazilian Depository Receipt - BDR - AAPL34 | 225.990,96 | 11,39 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - MSFT34 | 177.340,26 | 8,94 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - AMZO34 | 91.621,01 | 4,62 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - TSLA34 | 62.196,10 | 3,14 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - NVDC34 | 55.161,94 | 2,78 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - GOGI35 | 52.812,91 | 2,66 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - GOGI34 | 51.661,84 | 2,60 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - TSMC34 | 43.304,01 | 2,18 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - EXXO34 | 43.268,04 | 2,18 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - UNHH34 | 42.432,58 | 2,14 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - JPMC34 | 40.218,73 | 2,03 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - M1TA34 | 38.090,52 | 1,92 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - WALM34 | 36.610,61 | 1,85 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - MSCD34 | 32.431,78 | 1,63 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - PGCO34 | 31.117,44 | 1,57 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - CHVX34 | 29.622,07 | 1,49 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - HOME34 | 28.958,10 | 1,46 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - BOAC34 | 26.554,22 | 1,34 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - ABBV34 | 25.987,61 | 1,31 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - MRCK34 | 25.748,27 | 1,30 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - COCA34 | 24.799,13 | 1,25 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - AVGO34 | 24.371,15 | 1,23 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - ORCL34 | 22.596,00 | 1,14 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - BABA34 | 22.324,80 | 1,13 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - PFIZ34 | 21.720,94 | 1,10 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - TMO34 | 21.203,51 | 1,07 | Brazilian Depository Rece... |
| Brazilian Depository Receipt - BDR - TMOS34 | 21.044,12 | 1,06 | Brazilian Depository Rece... |

