



**LDB**  
EMPRESAS

**PAULÍNIA**  
JUNHO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 23.09.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 70,38%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

| Emissor                                | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   |
|--|----------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150824   | 8,58                | 1,26            | 3,98            | 153.708.927,09        | 12,27        |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150822   | 4,98                | 1,21            | 3,49            | 9.353.568,39          | 0,75         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150523   | 6,05                | 1,16            | 4,13            | 34.127.578,59         | 2,72         |
| TESOURO NACIONAL                       | LFT 010920     | 0,07                | 0,22            | 1,76            | 14.809.601,91         | 1,18         |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b> |                | <b>7,35</b>         | <b>1,17</b>     | <b>3,83</b>     | <b>211.999.675,98</b> | <b>16,92</b> |

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

| Gestor                                 | Admin. | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| BB                                     | BB     | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI             | 6,05                | 0,95            | 1,75            | 137.984.393,38        | 11,01        | 10.783.491.196,95 | 1,28    |
| CEF                                    | CEF    | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 5,96                | 0,75            | 4,63            | 222.574.934,49        | 17,77        | 12.211.119.756,17 | 1,82    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |        |  | <b>5,88</b>         | <b>0,83</b>     | <b>3,49</b>     | <b>360.559.327,87</b> | <b>28,78</b> |                   |         |

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

| Gestor                                   | Admin. | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|--|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| BRIDGE                                   | BRIDGE | TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5 | 16,49               | -3,02           | -18,07          | 15.343.902,72        | 1,22        | 69.013.013,24  | 22,23   |
| BRIDGE                                   | BRIDGE | TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5    | 31,20               | -3,09           | -31,24          | 42.503.765,43        | 3,39        | 275.800.114,54 | 15,41   |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |  | <b>27,40</b>        | <b>-3,07</b>    | <b>-28,18</b>   | <b>57.847.668,15</b> | <b>4,62</b> |                |         |

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                  | Admin.    | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|---|-----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| SANTANDER                               | SANTANDER | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,32                | 0,04            | 0,90            | 11.879.694,48         | 0,95         | 1.849.278.570,83 | 0,64    |
| BB                                      | BB        | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 0,17                | 0,26            | 0,96            | 17.248.152,60         | 1,38         | 2.439.958.346,20 | 0,71    |
| ITAU                                    | ITAU      | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI  | 1,67                | 0,44            | 2,27            | 68.254.575,91         | 5,45         | 5.170.951.886,47 | 1,32    |
| SANTANDER                               | SANTANDER | SANTANDER RF ATIVO FIC                         | 1,86                | 0,34            | 1,98            | 40.806.306,85         | 3,26         | 963.558.316,17   | 4,23    |
| TMJ                                     | RJI       | TMJ IMA-B FI RF                                | 13,33               | 0,00            | -12,00          | 25.607.678,17         | 2,04         | 173.188.086,82   | 14,79   |
| FMD                                     | FMD       | FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B             | 17,64               | -2,54           | -16,20          | 10.312.114,72         | 0,82         | 32.469.993,50    | 31,76   |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |           |  | <b>26,95</b>        | <b>-0,14</b>    | <b>-1,65</b>    | <b>174.108.522,73</b> | <b>13,90</b> |                  |         |

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

| Gestor                                   | Admin.     | Ativo                                     | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|--|------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| BRPP                                     | SANTANDER  | BBIF MASTER FIDC LP                       | 1,83                | -0,58           | -3,38           | 114.742,24           | 0,01        | 20.422.385,97  | 0,56    |
| GGR                                      | CM CAPITAL | GBX PRIME I FIDC                          | 17,29               | 0,23            | -3,64           | 12.341.765,54        | 0,99        | 171.029.545,64 | 7,22    |
| GRAPHEN                                  | ORLA       | LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC             | 3,60                | -0,21           | -2,96           | 5.877.530,84         | 0,47        | 74.024.321,09  | 7,94    |
| PLANNER                                  | PLANNER    | ILLUMINATI FIDC                           | 6,64                | -3,30           | -11,01          | 27.507.225,21        | 2,20        | 159.441.587,50 | 17,25   |
| RJI                                      | RJI        | INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B | 457,55              | 0,00            | 0,00            | 0,00                 | 0,00        | 0,00           |         |
| RJI                                      | RJI        | INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II          | 1,19                | -0,08           | -0,57           | 14.256.022,81        | 1,14        | 56.651.559,80  | 25,16   |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b> |            |   | <b>5,30</b>         | <b>-1,53</b>    | <b>-6,28</b>    | <b>60.097.286,64</b> | <b>4,80</b> |                |         |

## Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

| Gestor                                   | Admin.   | Ativo                   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo    | % Fundo |
|--|----------|-------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| BRPP                                     | INTRADER | PIATÁ FI RF LONGO PRAZO | 32,44               | 0,71            | -0,47           | 17.206.410,50         | 1,37         | 113.006.889,79 | 15,23   |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> |          |                         | <b>32,44</b>        | <b>0,71</b>     | <b>-0,47</b>    | <b>17.206.410,50</b>  | <b>1,37</b>  |                |         |
| <b>Renda Fixa</b>                        |          |                         | <b>7,48</b>         | <b>0,28</b>     | <b>-1,09</b>    | <b>881.818.891,87</b> | <b>70,38</b> |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,62%

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

| Gestor                                  | Admin. | Ativo                          | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|---|--------|--------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| GERAÇÃO FUTURO                          | BRB    | GERAÇÃO FI EM AÇÕES            | 41,61               | 8,60            | -18,80          | 33.893.434,35         | 2,71         | 325.482.350,79   | 10,41   |
| BRAM                                    | BEM    | BRADESCO F I A SELECTION       | 43,05               | 8,95            | -24,53          | 51.861.807,81         | 4,14         | 671.878.055,53   | 7,72    |
| ICATU                                   | BEM    | ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | 38,57               | 7,89            | -20,06          | 47.422.795,96         | 3,79         | 1.556.319.793,19 | 3,05    |
| BAHIA                                   | BEM    | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA  | 43,81               | 8,04            | -17,46          | 32.102.605,90         | 2,56         | 997.483.211,36   | 3,22    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI   | 41,04               | 11,47           | -16,29          | 40.179.334,33         | 3,21         | 1.573.476.047,46 | 2,55    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC         | 42,89               | 9,28            | -22,25          | 57.258.011,96         | 4,57         | 3.271.734.214,80 | 1,75    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                                | <b>41,35</b>        | <b>9,05</b>     | <b>-20,29</b>   | <b>262.717.990,31</b> | <b>20,97</b> |                  |         |

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor                         | Admin. | Ativo                                    | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|--------------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| FMD                            | FMD    | FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO | 11,93               | -1,44           | -11,34          | 35.944.664,63        | 2,87        | 177.866.325,31 | 20,21   |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b> |        |  | <b>11,93</b>        | <b>-1,44</b>    | <b>-11,34</b>   | <b>35.944.664,63</b> | <b>2,87</b> |                |         |

## Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

| Gestor                                  | Admin.     | Ativo                                      | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|---|------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| BRPP                                    | BNY MELLON | GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA     | 243,85              | -83,41          | -96,86          | 493.678,31           | 0,04        | 8.392.454,80     | 5,88    |
| CABEDAL                                 | CABEDAL    | FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES | 0,03                | -0,01           | -0,03           | 25.027.782,98        | 2,00        | 1.470.219.157,30 | 1,70    |
| A5                                      | PLANNER    | W7 FIP MULTIESTRATÉGIA                     | 1,20                | -0,16           | -0,96           | 2.077.612,13         | 0,17        | 135.394.292,29   | 1,53    |
| RJI                                     | RJI        | ÁTICO GESTÃO EMPRESARIAL - FIP             | 52,95               | 3,12            | 1,44            | 647.661,48           | 0,05        | 4.434.006,44     | 14,61   |
| QUELUZ                                  | BNY MELLON | ATICO FLORESTAL - FIP MULTIESTRATÉGIA      | 21,40               | -0,13           | 19,89           | 4.370.355,53         | 0,35        | 139.067.643,69   | 3,14    |
| INFRA ASSET                             | RJI        | INFRA SANEAMENTO - FIP                     | 10,62               | -0,17           | -0,89           | 13.025.558,23        | 1,04        | 408.824.159,43   | 3,19    |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b> |            |  | <b>22,94</b>        | <b>-5,18</b>    | <b>-24,28</b>   | <b>45.642.648,66</b> | <b>3,64</b> |                  |         |

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                      | Admin.      | Ativo                                 | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|---|-------------|---------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| BRIDGE                                      | ELITE       | BR HOTÉIS FII                         | 0,36                | -0,11           | -0,60           | 13.129.101,65        | 1,05        | 157.205.134,50 | 8,35    |
| INFRA ASSET                                 | INFRA ASSET | FII INFRA REAL ESTATE - FII           | 19,49               | -0,21           | -16,99          | 1.202.937,69         | 0,10        | 104.961.916,22 | 1,15    |
| RJI   | RJI         | HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO | 2,24                | 2,26            | 2,36            | 12.413.010,15        | 0,99        | 72.078.280,94  | 17,22   |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>     |             |                                       | <b>1,45</b>         | <b>0,97</b>     | <b>-0,13</b>    | <b>26.745.049,49</b> | <b>2,13</b> |                |         |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |             |                                       | 27,43               | 5,41            | -18,88          | 371.050.353,09       | 29,62       |                |         |
| Total                                       |             |                                       |                     |                 |                 | 1.252.869.244,96     | 100,00      |                |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo   | Tipo de Ativo  | Valor(R\$)            | % Carteira   | Política de Investimentos |          |        | Pró-Gestão Nível 1 |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|
|  |  |                       |              | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | Limite Legal       |
| <b>Renda Fixa</b>                                  |  |                       |              |                           |          |        |                    |
| Artigo 7º I, Alínea a                              | Títulos do Tesouro Nacional                              | 211.999.675,98        | 16,92        | 0,00                      | 20,00    | 100,00 | 100,00             |
| Artigo 7º I, Alínea b                              | Fundos 100% Títulos Públicos                             | 360.559.327,87        | 28,78        | 0,00                      | 40,00    | 100,00 | 100,00             |
| Artigo 7º III, Alínea a                            | Fundos Renda Fixa Referenciados                          | 57.847.668,15         | 4,62         | 0,00                      | 3,00     | 60,00  | 65,00              |
| Artigo 7º IV, Alínea a                             | Fundos de Renda Fixa                                     | 174.108.522,73        | 13,90        | 0,00                      | 3,00     | 40,00  | 45,00              |
| Artigo 7º VII, Alínea a                            | Cota Sênior de FIDC                                      | 60.097.286,64         | 4,80         | 0,00                      | 0,00     | 5,00   | 5,00               |
| Artigo 7º VII, Alínea b                            | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"                      | 17.206.410,50         | 1,37         | 0,00                      | 0,00     | 5,00   | 10,00              |
|  | <b>Total Renda Fixa</b>                                  | <b>881.818.891,87</b> | <b>70,38</b> |                           |          |        |                    |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |                       |              |                           |          |        |                    |
| Artigo 8º II, Alínea a                             | Fundos de Ações  | 262.717.990,31        | 20,97        | 0,00                      | 25,00    | 20,00  | 25,00              |
| Artigo 8º III                                      | Fundos Multimercados                                     | 35.944.664,63         | 2,87         | 0,00                      | 0,00     | 10,00  | 10,00              |
| Artigo 8º IV, Alínea a                             | Fundos de Participações                                  | 45.642.648,66         | 3,64         | 0,00                      | 0,00     | 5,00   | 5,00               |
| Artigo 8º IV, Alínea b                             | Fundos de Investimentos Imobiliários                     | 26.745.049,49         | 2,13         | 0,00                      | 0,00     | 5,00   | 5,00               |
|  | <b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> | <b>371.050.353,09</b> | <b>29,62</b> |                           |          |        |                    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador                         | No Mês             | No Ano              | 3 meses          | 6 meses             | 12 meses          | No Mês(R\$)   | No Ano(R\$)    |
|--|--------------------|---------------------|------------------|---------------------|-------------------|---------------|----------------|
| Artigo 7º I, Alínea a<br>% do CDI            | 1,17<br>549,20     | 3,83<br>218,42      | 4,73<br>644,15   | 3,83<br>218,42      | 10,04<br>218,09   | 2.443.640,39  | 7.884.813,64   |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | 0,83<br>389,07     | 3,49<br>199,15      | 3,15<br>428,98   | 3,49<br>199,15      | 8,73<br>189,62    | 2.958.435,47  | 12.300.464,52  |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | -3,07<br>-1.445,10 | -28,18<br>-1.606,20 | -2,68<br>-364,40 | -28,18<br>-1.606,20 | -26,41<br>-573,68 | -1.831.153,02 | -22.696.402,42 |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | -0,14<br>-65,36    | -1,65<br>-93,81     | 0,27<br>36,99    | -1,65<br>-93,81     | 0,65<br>14,18     | -285.750,70   | -2.981.863,04  |
| Artigo 7º VII, Alínea a<br>% do CDI          | -1,53<br>-720,33   | -6,28<br>-357,98    | -3,85<br>-524,07 | -6,28<br>-357,98    | -7,12<br>-154,76  | -933.434,46   | -4.003.040,87  |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 0,71<br>336,32     | -0,47<br>-26,53     | 0,59<br>80,26    | -0,47<br>-26,53     | 33,72<br>732,46   | 121.999,61    | -87.032,14     |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 9,05<br>0,29       | -20,29<br>-2,49     | 26,81<br>-3,37   | -20,29<br>-2,49     | -7,24<br>-1,39    | 21.798.425,01 | -67.598.560,28 |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | -1,44<br>-10,20    | -11,34<br>6,46      | -1,33<br>-31,51  | -11,34<br>6,46      | -13,32<br>-7,46   | -525.724,95   | -4.597.079,09  |
| Artigo 8º IV, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -5,18<br>-13,94    | -24,28<br>-6,48     | -24,16<br>-54,34 | -24,28<br>-6,48     | -23,95<br>-18,10  | -2.494.623,44 | -14.637.091,15 |
| Artigo 8º IV, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | 0,97<br>-7,79      | -0,13<br>17,67      | -0,11<br>-30,29  | -0,13<br>17,67      | -0,27<br>5,58     | 256.153,50    | -35.893,09     |
|  |                    |                     |                  |                     |                   | 21.507.967,41 | -96.451.683,92 |

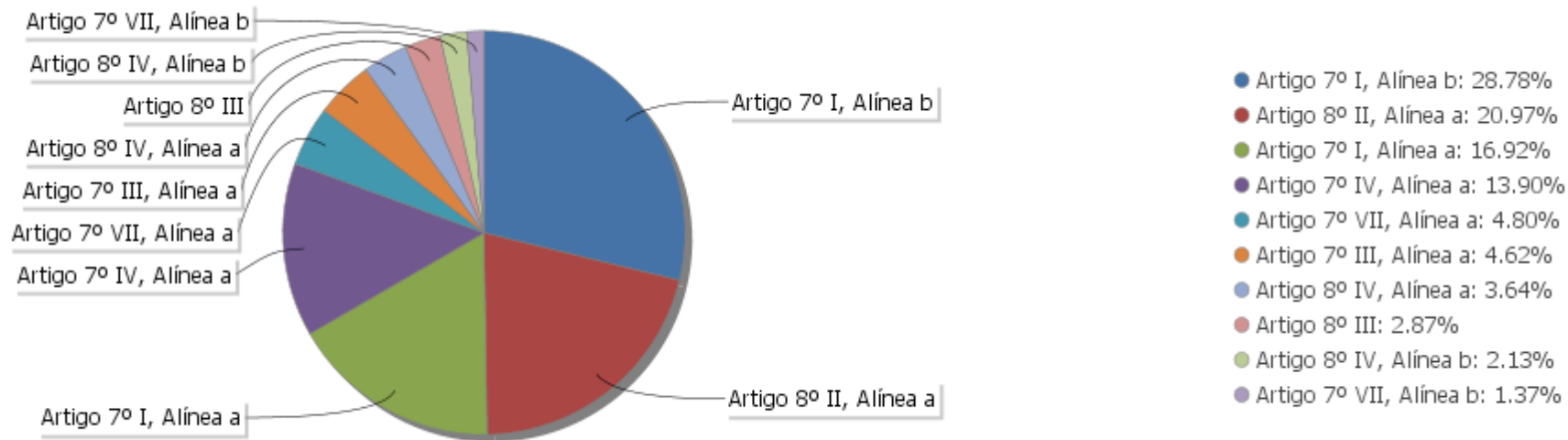
## Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 673.535.588,68 | 53,76 | 673.535.588,68        | 53,76     |
| de 31 a 364 dias  | 144.997.215,58 | 11,57 | 818.532.804,26        | 65,33     |
| acima de 365 dias | 434.336.440,70 | 34,67 | 1.252.869.244,96      | 100,00    |

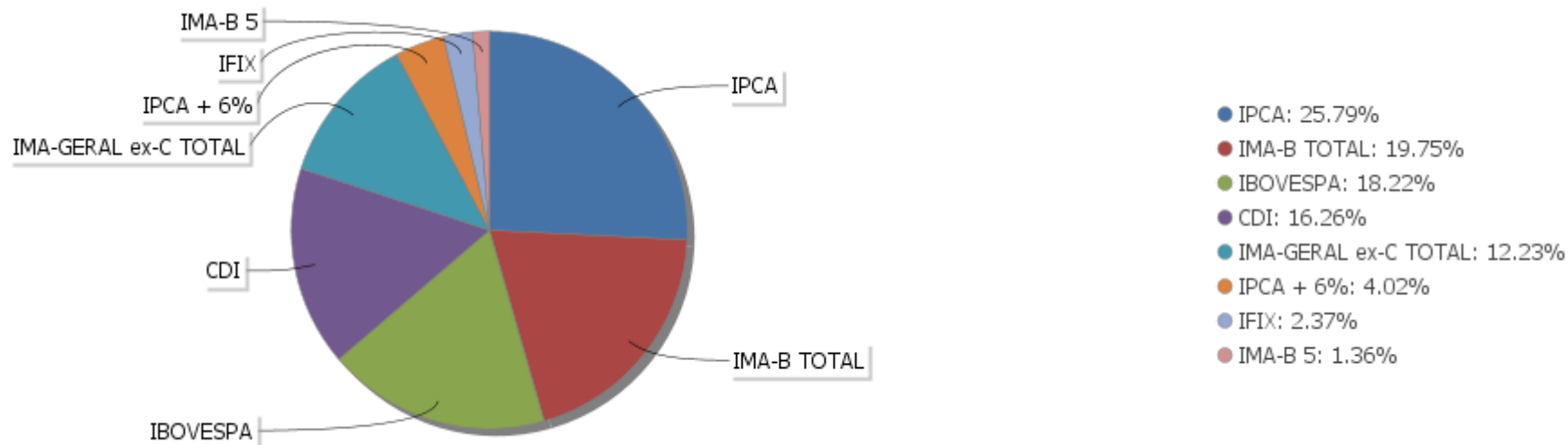


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

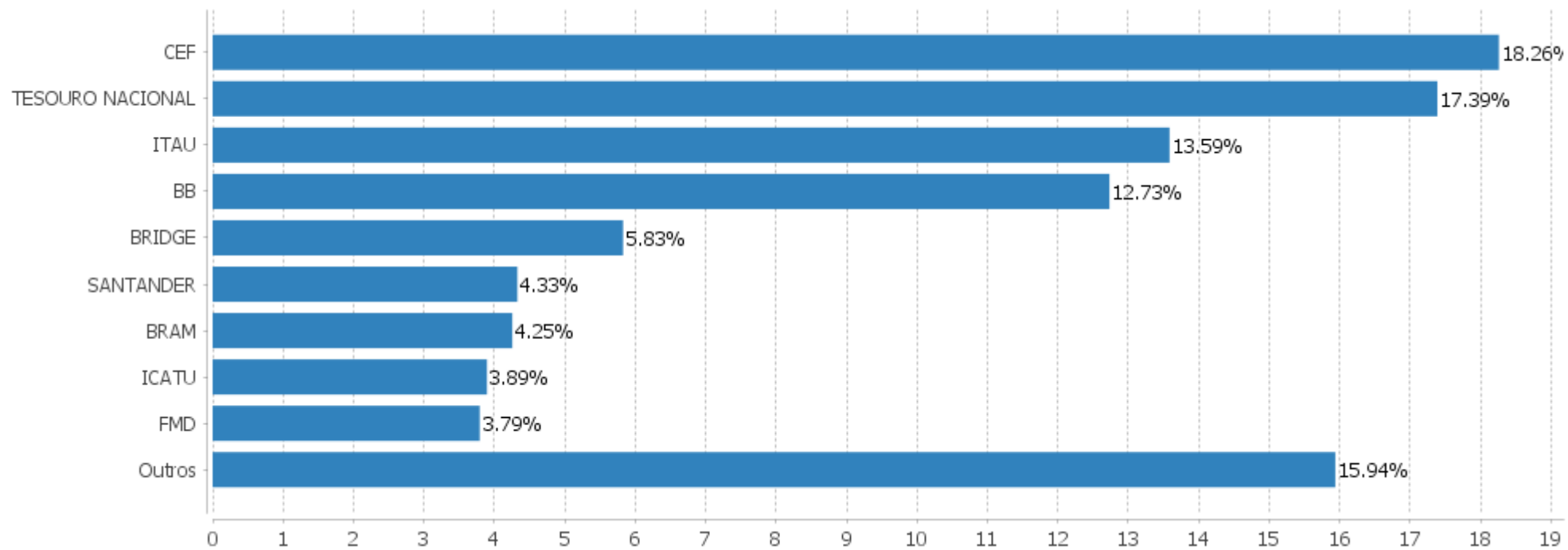


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

| Ano            | Jan   | Fev   | Mar    | Abr   | Mai  | Jun  | Jul   | Ago   | Set  | Out  | Nov   | Dez  | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|--------|-------|------|------|-------|-------|------|------|-------|------|-----------|
| 2020           | 0,19  | -2,02 | -9,75  | 0,86  | 2,11 | 1,75 |       |       |      |      |       |      | -7,16     |
| IPCA + 5,89%   | 0,71  | 0,66  | 0,57   | 0,14  | 0,07 | 0,74 |       |       |      |      |       |      | 2,93      |
| p.p. indexador | -0,52 | -2,68 | -10,32 | 0,72  | 2,03 | 1,01 |       |       |      |      |       |      | -10,09    |
| 2019           | 1,46  | -0,24 | -0,07  | 0,78  | 1,32 | 1,97 | 0,70  | 0,08  | 1,48 | 1,61 | 0,10  | 2,21 | 12,00     |
| IPCA + 6%      | 0,83  | 0,90  | 1,19   | 1,06  | 0,64 | 0,45 | 0,72  | 0,62  | 0,45 | 0,63 | 0,98  | 1,64 | 10,59     |
| p.p. indexador | 0,63  | -1,14 | -1,26  | -0,28 | 0,68 | 1,52 | -0,02 | -0,54 | 1,04 | 0,98 | -0,87 | 0,57 | 1,41      |

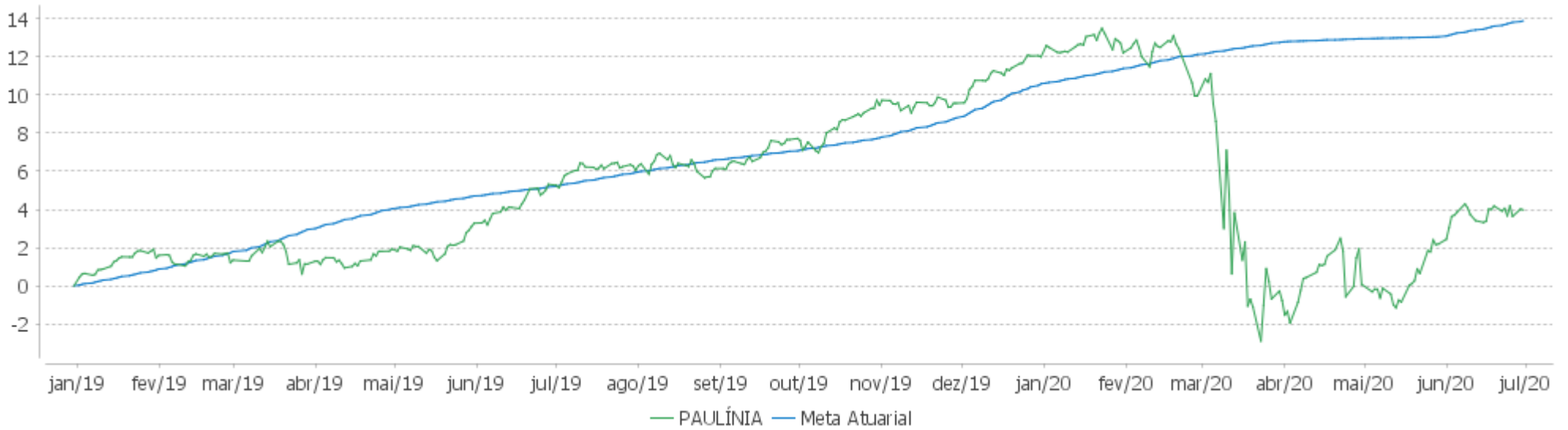
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

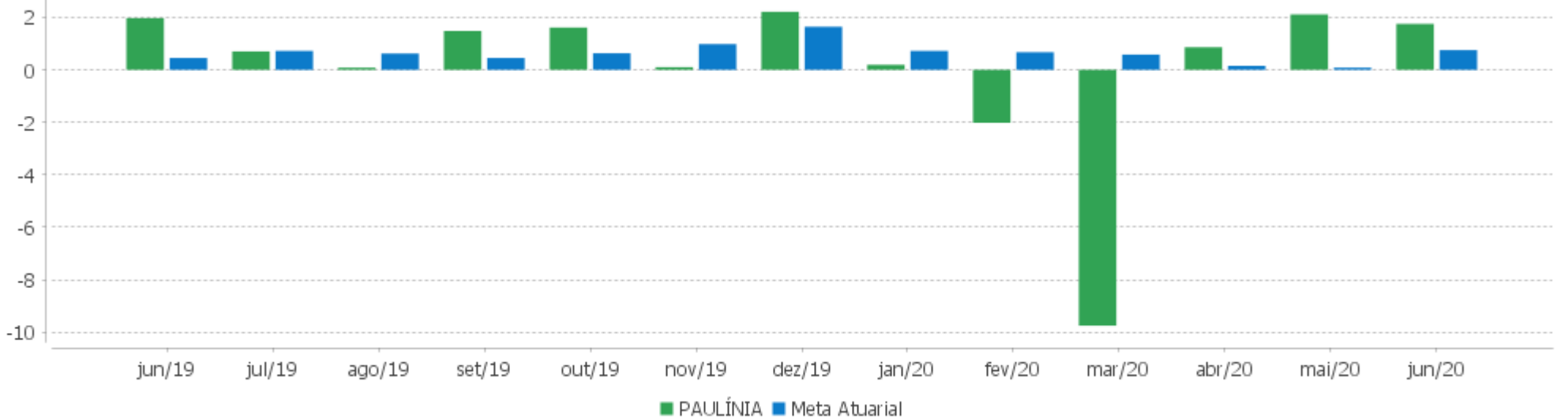
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 9          | 50,00     | 03 meses         | 4,79     | 0,96          | 3,83       | 9,73               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 9          | 50,00     | 06 meses         | -7,16    | 2,93          | -10,09     | 16,83              |
|                                 |            |           | 12 meses         | -1,28    | 8,23          | -9,51      | 11,97              |
|                                 |            |           | 24 meses         |          |               |            |                    |
|                                 |            |           | 36 meses         |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,21       | 2019-12   |                  |          |               |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -9,75      | 2020-03   | Desde 31/12/2018 | 3,98     | 13,83         | -9,85      | 10,01              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia   | No Mês           | No Ano           | 3 meses          | 6 meses          | 12 meses            | 24 meses              | 36 meses          |
|---|------------------|------------------|------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.            | 0,95<br>0,05     | 1,75<br>0,04     | 2,96<br>0,22     | 1,75<br>0,04     | 6,31<br>-0,01       | 23,29<br>0,35         | 33,67<br>0,56     |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.                | 0,75<br>0,49     | 4,63<br>4,53     | 3,27<br>3,70     | 4,63<br>4,53     | 9,82<br>7,69        | 28,20<br>22,63        | 38,61<br>28,41    |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5<br>Var. IMA-B 5 p.p. | -3,02<br>-4,14   | -18,07<br>-21,24 | -1,89<br>-5,66   | -18,07<br>-21,24 | -16,87<br>-25,68    | -13,86<br>-38,62      | -21,09<br>-57,99  |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5                         | -3,09            | -31,24           | -2,96            | -31,24           | -29,33              | -34,47                |                   |
| PIATÁ FI RF LONGO PRAZO<br>% do CDI   | 0,71<br>336,32   | -0,47<br>-26,53  | 0,59<br>80,26    | -0,47<br>-26,53  | 33,72<br>732,46     | 31,35<br>279,58       | -22,96<br>-118,40 |
| NTN-B 150824<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | 1,26<br>-0,79    | 3,98<br>5,64     | 5,22<br>0,26     | 3,98<br>5,64     | 10,54<br>5,59       | 34,38<br>-0,75        | 46,64<br>0,44     |
| LFT 010920  | 0,22             | 1,76             | 0,74             | 1,76             | 4,62                | 11,24                 | 19,49             |
| NTN-B 150822<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | 1,21<br>-0,84    | 3,49<br>5,15     | 3,84<br>-1,12    | 3,49<br>5,15     | 9,22<br>4,27        | 28,44<br>-6,69        | 41,44<br>-4,77    |
| NTN-B 150523<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | 1,16<br>-0,89    | 4,13<br>5,79     | 4,58<br>-0,38    | 4,13<br>5,79     | 10,40<br>5,45       | 32,12<br>-3,01        | 44,82<br>-1,39    |
| SANTANDER RF ATIVO FIC<br>% do CDI  | 0,34<br>158,71   | 1,98<br>112,88   | 1,27<br>172,85   | 1,98<br>112,88   | 6,89<br>149,69      | 20,42<br>182,12       | 25,36<br>130,78   |
| TMJ IMA-B FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                                      | -1,90<br>-3,95   | -12,00<br>-10,33 | -0,91<br>-5,86   | -12,00<br>-10,33 | -8,36<br>-13,30     | -5,21<br>-40,34       |                   |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                                | 0,26<br>122,46   | 1,37<br>78,16    | 0,78<br>105,60   | 1,37<br>78,16    | 4,06<br>88,25       | 10,51<br>93,70        | 18,70<br>96,43    |
| FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B  | -2,54            | -16,20           | -6,81            | -16,20           | -22,71              | -32,46                |                   |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI<br>% do CDI                    | 0,04<br>18,39    | 0,90<br>51,49    | 0,32<br>43,32    | 0,90<br>51,49    | 3,57<br>77,60       | 10,11<br>90,16        | 18,21<br>93,93    |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.               | 0,44<br>0,18     | 2,27<br>2,17     | 1,12<br>1,55     | 2,27<br>2,17     | 5,62<br>3,49        | 19,25<br>13,67        | 31,68<br>21,48    |
| INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II<br>% do CDI                                  | -0,08<br>-36,65  | -0,57<br>-32,22  | -0,26<br>-35,04  | -0,57<br>-32,22  | 0,67<br>14,54       | 1,57<br>13,97         |                   |
| INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B<br>% do CDI                         | 0,00<br>0,00     | 0,00<br>0,00     | 0,00<br>0,00     | 0,00<br>0,00     | -78,40<br>-1.703,11 | -94,36<br>-841,54     |                   |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC<br>% do CDI                                     | -0,21<br>-101,22 | -2,96<br>-168,58 | -0,91<br>-123,33 | -2,96<br>-168,58 | -7,28<br>-158,22    | 1.352,25<br>12.059,85 |                   |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                               | No Mês           | No Ano            | 3 meses          | 6 meses           | 12 meses          | 24 meses          | 36 meses          |
|---|------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| BBIF MASTER FIDC LP<br>% do CDI                               | -0,58<br>-270,90 | -3,38<br>-192,65  | -1,85<br>-252,17 | -3,38<br>-192,65  | -6,98<br>-151,62  | -32,09<br>-286,17 | -76,91<br>-396,64 |
| ILLUMINATI FIDC<br>Var. IPCA + 6% p.p.                        | -3,30<br>-4,04   | -11,01<br>-14,00  | -6,71<br>-7,69   | -11,01<br>-14,00  | -11,74<br>-20,03  | -17,38<br>-35,94  |                   |
| GBX PRIME I FIDC<br>% do CDI                                  | 0,23<br>109,13   | -3,64<br>-207,33  | -2,65<br>-361,03 | -3,64<br>-207,33  | -6,98<br>-151,74  | -7,21<br>-64,31   | -27,48<br>-141,74 |
| FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO<br>% do CDI          | -1,44<br>-678,91 | -11,34<br>-646,33 | -1,33<br>-180,98 | -11,34<br>-646,33 | -13,32<br>-289,35 | -24,49<br>-218,40 |                   |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA<br>% do CDI                            | -0,16<br>-77,66  | -0,96<br>-54,83   | -0,48<br>-65,08  | -0,96<br>-54,83   | -1,97<br>-42,77   | -3,89<br>-34,71   |                   |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA<br>Var. IPCA + 6% p.p. | -83,41<br>-84,16 | -96,86<br>-99,85  | -96,86<br>-97,84 | -96,86<br>-99,85  | -96,85<br>-105,14 | -96,83<br>-115,40 | -97,52<br>-128,62 |
| FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES<br>% do CDI        | -0,01<br>-3,20   | -0,03<br>-1,70    | -0,02<br>-2,78   | -0,03<br>-1,70    | -0,07<br>-1,47    | -0,17<br>-1,55    | -0,16<br>-0,85    |
| ÁTICO GESTÃO EMPRESARIAL - FIP<br>% do CDI                    | 3,12<br>1.469,34 | 1,44<br>81,90     | 2,20<br>299,06   | 1,44<br>81,90     | -1,16<br>-25,22   | -4,60<br>-41,04   |                   |
| INFRA SANEAMENTO - FIP<br>Var. IPCA + 6% p.p.                 | -0,17<br>-0,91   | -0,89<br>-3,87    | -0,43<br>-1,41   | -0,89<br>-3,87    | -1,42<br>-9,71    | -3,00<br>-21,56   | -4,76<br>-35,87   |
| ATICO FLORESTAL - FIP MULTIESTRATÉGIA<br>Var. IPCA + 6% p.p.  | -0,13<br>-0,88   | 19,89<br>16,90    | 20,36<br>19,38   | 19,89<br>16,90    | 32,75<br>24,47    | -19,74<br>-38,31  | -20,97<br>-52,07  |
| GERAÇÃO FI EM AÇÕES<br>Var. IBOVESPA p.p.                     | 8,60<br>-0,16    | -18,80<br>-1,00   | 28,15<br>-2,03   | -18,80<br>-1,00   | -8,80<br>-2,95    | 24,60<br>-6,04    | 26,89<br>-24,23   |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI<br>Var. IBOVESPA p.p.            | 11,47<br>2,71    | -14,65<br>3,16    | 31,23<br>1,05    | -14,65<br>3,16    | 0,85<br>6,71      | 42,00<br>11,36    | 73,22<br>22,09    |
| BRADESCO F I A SELECTION<br>Var. IBOVESPA p.p.                | 8,95<br>0,20     | -24,53<br>-6,73   | 25,56<br>-4,62   | -24,53<br>-6,73   | -13,47<br>-7,62   | 19,34<br>-11,30   | 54,11<br>2,98     |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.           | 8,04<br>-0,71    | -17,46<br>0,34    | 29,18<br>-0,99   | -17,46<br>0,34    | -4,65<br>1,20     | 30,74<br>0,10     | 62,43<br>11,31    |
| ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC  | 9,28             | -22,25            | 27,83            | -22,25            | -4,41             | 36,54             |                   |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.          | 7,89<br>-0,86    | -20,06<br>-2,25   | 21,11<br>-9,07   | -20,06<br>-2,25   | -6,28<br>-0,43    | 44,97<br>14,33    | 54,60<br>3,47     |
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO<br>Var. IFIX p.p.       | 2,26<br>-3,34    | 2,36<br>14,60     | 2,21<br>-10,31   | 2,36<br>14,60     | 2,35<br>-4,51     | 19,41<br>-12,63   |                   |
| BR HOTÉIS FII<br>Var. IFIX p.p.                               | -0,11<br>-5,71   | -0,60<br>11,64    | -0,35<br>-12,87  | -0,60<br>11,64    | -0,87<br>-7,73    | -5,89<br>-37,94   | 3,67<br>-31,63    |
| FII INFRA REAL ESTATE - FII                                   | -0,21            | -16,99            | -17,52           | -16,99            | -17,01            | -20,43            |                   |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IFIX p.p.                  | -5,80  | -4,76  | -30,04  | -4,76   | -23,87   | -52,48   |          |
| CDI                             | 0,21   | 1,75   | 0,73    | 1,75    | 4,60     | 11,21    | 19,39    |
| IBOVESPA                        | 8,76   | -17,80 | 30,18   | -17,80  | -5,85    | 30,64    | 51,12    |
| INPC + 6%                       | 0,79   | 3,25   | 1,24    | 3,25    | 8,51     | 18,75    | 30,23    |
| IPCA + 6%                       | 0,75   | 2,99   | 0,98    | 2,99    | 8,29     | 18,56    | 31,11    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

| Indexador                     | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| <b>Renda Fixa</b>             |        |        |         |         |          |          |          |
| IRF-M 1                       | 0,28   | 2,60   | 1,15    | 2,60    | 6,01     | 13,67    | 22,54    |
| IRF-M 1+                      | 1,04   | 6,03   | 4,53    | 6,03    | 11,80    | 33,23    | 45,60    |
| IRF-M TOTAL                   | 0,79   | 4,86   | 3,39    | 4,86    | 9,81     | 27,08    | 38,44    |
| IMA-B 5                       | 1,12   | 3,17   | 3,77    | 3,17    | 8,81     | 24,75    | 36,90    |
| IMA-B 5+                      | 2,84   | -5,26  | 5,99    | -5,26   | 1,97     | 43,55    | 52,33    |
| IMA-B TOTAL                   | 2,05   | -1,66  | 4,96    | -1,66   | 4,95     | 35,13    | 46,21    |
| IMA-C TOTAL                   | 3,74   | 7,46   | 7,95    | 7,46    | 13,21    | 41,24    | 63,14    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | 0,90   | 1,71   | 2,74    | 1,71    | 6,32     | 22,95    | 33,11    |
| IMA-GERAL TOTAL               | 0,99   | 1,87   | 2,89    | 1,87    | 6,52     | 23,45    | 33,90    |
| IDKA 2                        | 0,99   | 3,35   | 3,35    | 3,35    | 8,77     | 23,17    | 35,46    |
| IDKA 20                       | 4,18   | -12,33 | 6,49    | -12,33  | -4,69    | 58,14    | 62,45    |
| CDI                           | 0,21   | 1,75   | 0,73    | 1,75    | 4,60     | 11,21    | 19,39    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | 8,76   | -17,80 | 30,18   | -17,80  | -5,85    | 30,64    | 51,12    |
| IBRX 100                      | 8,97   | -17,39 | 30,39   | -17,39  | -4,66    | 34,21    | 53,90    |
| IBRX 50                       | 9,33   | -17,76 | 31,79   | -17,76  | -6,93    | 27,59    | 47,47    |
| SMALL CAP                     | 14,43  | -20,73 | 32,49   | -20,73  | 5,15     | 49,01    | 69,83    |
| IFIX                          | 5,59   | -12,24 | 12,52   | -12,24  | 6,86     | 32,05    | 35,30    |
| Índice Consumo - ICON         | 10,08  | -10,90 | 39,45   | -10,90  | 13,99    | 52,93    | 55,22    |
| Índice Dividendos - IDIV      | 8,95   | -18,38 | 18,70   | -18,38  | -0,15    | 47,52    | 60,57    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,26   | 0,10   | -0,43   | 0,10    | 2,13     | 5,57     | 10,21    |
| INPC                          | 0,30   | 0,36   | -0,18   | 0,36    | 2,35     | 5,74     | 9,47     |
| IGPM                          | 1,56   | 4,39   | 2,66    | 4,39    | 7,31     | 14,30    | 22,21    |
| SELIC                         | 0,21   | 1,75   | 0,73    | 1,75    | 4,60     | 11,21    | 19,40    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

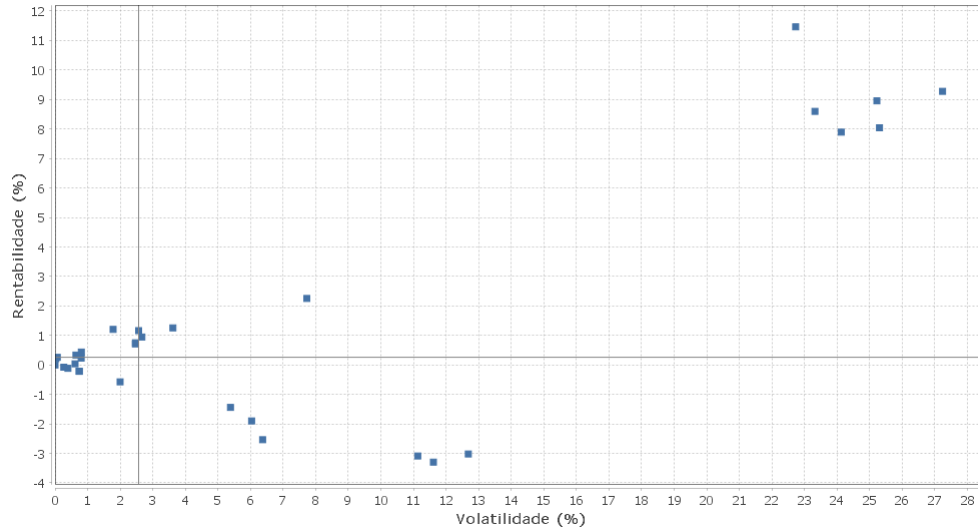
## Movimentações

| APR | Data       | Ativo  | Aplicação    | Resgate      | Quantidade         | Valor Cota     |
|-----|------------|--|--------------|--------------|--------------------|----------------|
| 173 | 02/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 1.050,00     | 0,00         | 5,68547197         | 184,6812377000 |
| 194 | 02/06/2020 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF   | 0,00         | 428.709,91   | 289.820,42635811   | 1,4792260000   |
| 196 | 02/06/2020 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF   | 0,00         | 6.384,72     | 4.316,25728590     | 1,4792260000   |
| 174 | 04/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 2.992,46     | 16,19990466        | 184,7208402000 |
| 175 | 04/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 1.050,22     | 5,68544404         | 184,7208402000 |
| 176 | 05/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 6.697.805,56 | 0,00         | 36.255,64941991    | 184,7382592000 |
| 192 | 05/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 3.387.308,94 | 0,00         | 1.489.435,44551400 | 2,2742233980   |
| 193 | 05/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 40.898,33    | 0,00         | 17.983,42679700    | 2,2742233980   |
| 197 | 05/06/2020 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF   | 755.700,83   | 0,00         | 511.188,93744250   | 1,4783200000   |
| 177 | 08/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 24.087,25    | 130,37748781       | 184,7500700000 |
| 199 | 08/06/2020 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI               | 132.000,00   | 0,00         | 89.520,55751700    | 1,4745216480   |
| 178 | 10/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 53.768,58    | 290,98226481       | 184,7830143000 |
| 179 | 15/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 48.685,51    | 263,39729200       | 184,8367902000 |
| 180 | 16/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 12.019,00    | 0,00         | 65,01689824        | 184,8596338000 |
| 181 | 17/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 2.843,57     | 15,38060666        | 184,8802237000 |
| 182 | 18/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 867.889,59   | 0,00         | 4.693,65749785     | 184,9068856000 |
| 198 | 18/06/2020 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF   | 2.604,04     | 0,00         | 1.760,97260458     | 1,4787510000   |
| 183 | 22/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 1.233,69     | 0,00         | 6,68218745         | 184,6236743000 |
| 184 | 23/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 11.844,46    | 64,15021418        | 184,6363282000 |
| 185 | 23/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 1.233,77     | 6,68216278         | 184,6363282000 |
| 200 | 23/06/2020 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI               | 0,00         | 1.300.356,26 | 882.546,61007800   | 1,4734136930   |
| 186 | 30/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 685.659,18   | 3.712,16776119     | 184,7058711000 |
| 187 | 30/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 5.225,33     | 28,29000491        | 184,7058711000 |
| 188 | 30/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 6.570.152,66 | 35.570,89236456    | 184,7058711000 |
| 189 | 30/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 9.168,11     | 49,63626736        | 184,7058711000 |
| 190 | 30/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 855.097,17   | 4.629,50725338     | 184,7058711000 |
| 191 | 30/06/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 1.560,00     | 0,00         | 8,44586039         | 184,7058711000 |

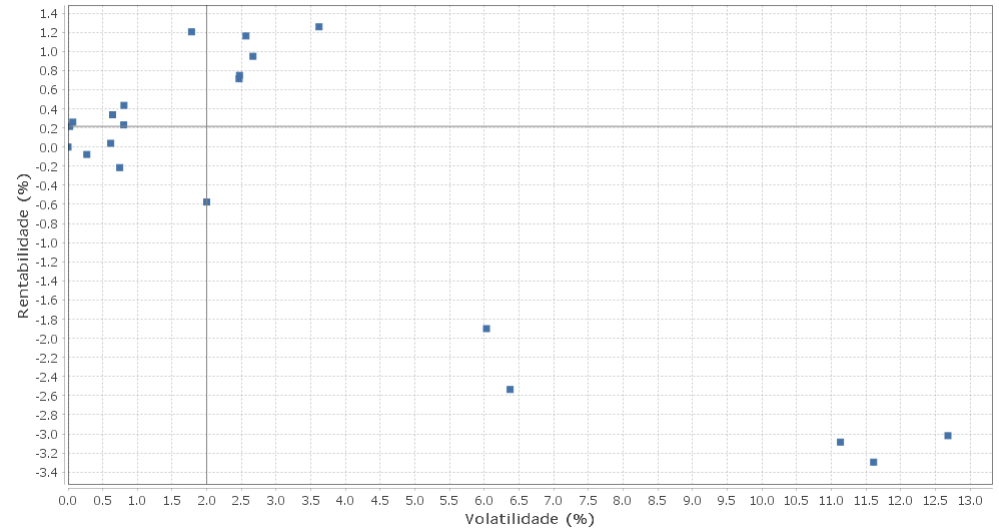
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

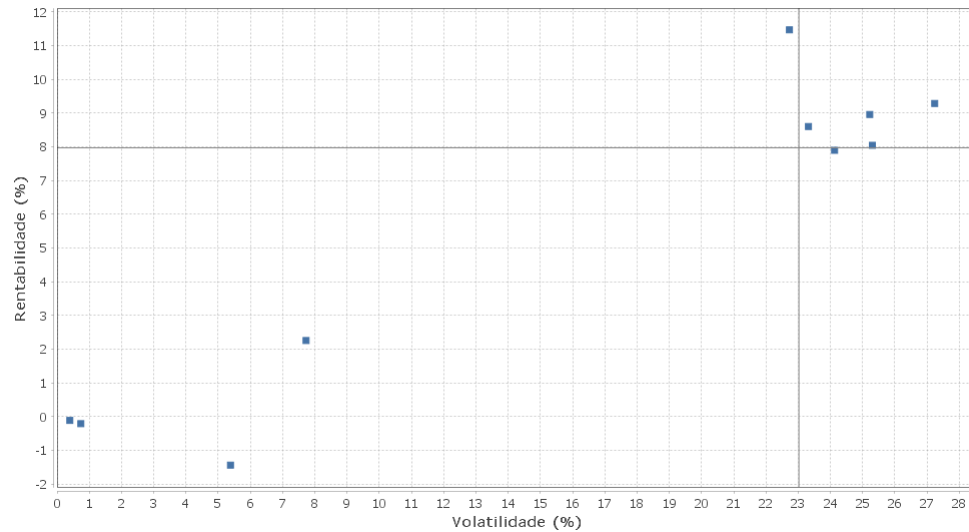
PAULÍNIA - No Mês



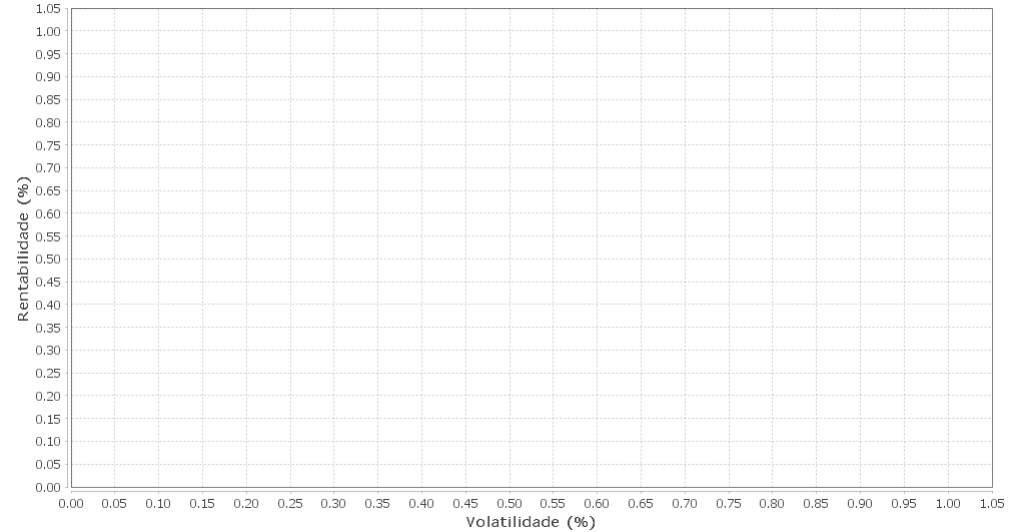
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Estratégia              | Volatilidade | VaR   | CVaR  | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--|-------------------------|--------------|-------|-------|--------|-------|----------------|------------|
| INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC - Série B                | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,00         | NaN   | 0,00  | -      | 0,00  | 0,00           | 0,00       |
| LFT 010920   | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,02         | 0,02  | -0,00 | 0,16   | 0,22  | 14.809.601,91  | 1,18       |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                       | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,07         | 0,11  | -0,00 | 0,70   | 0,26  | 17.248.152,60  | 1,38       |
| INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II                         | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,27         | 0,02  | 0,00  | -1,08  | -0,08 | 14.256.022,81  | 1,14       |
| BR HOTÉIS FII  | Artigo 8º IV, Alínea b  | 0,40         | 0,02  | 0,00  | -0,82  | -0,11 | 13.129.101,65  | 1,05       |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI           | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,62         | 0,24  | -0,00 | -0,28  | 0,04  | 11.879.694,48  | 0,95       |
| SANTANDER RF ATIVO FIC                                   | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,64         | 0,53  | 0,01  | 0,19   | 0,34  | 40.806.306,85  | 3,26       |
| FII INFRA REAL ESTATE - FII                              | Artigo 8º IV, Alínea b  | 0,74         | 0,86  | 0,00  | -0,58  | -0,21 | 1.202.937,69   | 0,10       |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC                            | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,75         | 0,13  | 0,00  | -0,57  | -0,21 | 5.877.530,84   | 0,47       |
| GBX PRIME I FIDC   | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,80         | 0,19  | 0,00  | 0,02   | 0,23  | 12.341.765,54  | 0,99       |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI            | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,81         | 0,54  | 0,01  | 0,28   | 0,44  | 68.254.575,91  | 5,45       |
| NTN-B 150822   | Artigo 7º I, Alínea a   | 1,78         | 2,74  | 0,01  | 0,56   | 1,21  | 9.353.568,39   | 0,75       |
| BBIF MASTER FIDC LP                                      | Artigo 7º VII, Alínea a | 2,00         | 0,13  | 0,00  | -0,39  | -0,58 | 114.742,24     | 0,01       |
| PIATÁ FI RF LONGO PRAZO                                  | Artigo 7º VII, Alínea b | 2,46         | 0,05  | 0,00  | 0,20   | 0,71  | 17.206.410,50  | 1,37       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF             | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,47         | 2,80  | 0,41  | 0,22   | 0,75  | 222.574.934,49 | 17,77      |
| NTN-B 150523   | Artigo 7º I, Alínea a   | 2,56         | 3,73  | 0,08  | 0,37   | 1,16  | 34.127.578,59  | 2,72       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                         | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,67         | 3,94  | 0,37  | 0,28   | 0,95  | 137.984.393,38 | 11,01      |
| NTN-B 150824   | Artigo 7º I, Alínea a   | 3,62         | 5,17  | 0,53  | 0,29   | 1,26  | 153.708.927,09 | 12,27      |
| FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO                 | Artigo 8º III           | 5,38         | 1,33  | 0,01  | -0,31  | -1,44 | 35.944.664,63  | 2,87       |
| TMJ IMA-B FI RF  | Artigo 7º IV, Alínea a  | 6,03         | 10,45 | 0,13  | -0,35  | -1,90 | 25.607.678,17  | 2,04       |
| FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B                       | Artigo 7º IV, Alínea a  | 6,37         | 7,95  | -0,01 | -0,43  | -2,54 | 10.312.114,72  | 0,82       |
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO                    | Artigo 8º IV, Alínea b  | 7,73         | 0,11  | 0,00  | 0,26   | 2,26  | 12.413.010,15  | 0,99       |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5    | Artigo 7º III, Alínea a | 11,13        | 4,77  | 0,00  | -0,30  | -3,09 | 42.503.765,43  | 3,39       |
| ILLUMINATI FIDC  | Artigo 7º VII, Alínea a | 11,61        | 0,47  | 0,00  | -0,30  | -3,30 | 27.507.225,21  | 2,20       |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5 | Artigo 7º III, Alínea a | 12,68        | 5,75  | 0,01  | -0,25  | -3,02 | 15.343.902,72  | 1,22       |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI                             | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,73        | 27,98 | 0,88  | 0,50   | 11,47 | 40.179.334,33  | 3,21       |
| GERAÇÃO FI EM AÇÕES                                      | Artigo 8º II, Alínea a  | 23,32        | 31,01 | 0,82  | 0,36   | 8,60  | 33.893.434,35  | 2,71       |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                           | Artigo 8º II, Alínea a  | 24,13        | 30,18 | 1,11  | 0,32   | 7,89  | 47.422.795,96  | 3,79       |
| BRADESCO F I A SELECTION                                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 25,22        | 30,47 | 1,22  | 0,35   | 8,95  | 51.861.807,81  | 4,14       |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                         | Estratégia             | Volatilidade | VaR   | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|-------------------------------|------------------------|--------------|-------|------|--------|-------|---------------|------------|
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 25,30        | 30,15 | 0,76 | 0,31   | 8,04  | 32.102.605,90 | 2,56       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC        | Artigo 8º II, Alínea a | 27,24        | 29,79 | 1,34 | 0,33   | 9,28  | 57.258.011,96 | 4,57       |