



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
AGOSTO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.08.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

82,24%

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	5,67	-1,10	-2,39	20.692.743,17	2,40	340.081.564,52	6,08
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,72	-1,11	-2,33	28.968.796,30	3,36	474.837.001,82	6,10
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,33	1,16	148.191.155,03	17,21	7.563.467.815,66	1,96
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,81	-1,59	-4,31	59.237.993,61	6,88	797.206.710,02	7,43
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,74	-1,13	-2,31	30.735.854,28	3,57	7.360.711.745,51	0,42
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,73	-1,12	-2,41	32.046.267,47	3,72	673.531.762,90	4,76
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,73	-1,14	-2,35	62.444.823,71	7,25	5.489.990.227,20	1,14
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,49	0,32	1,09	17.187,21	0,00	38.402.423,44	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,34	1,21	44.910.909,12	5,22	7.025.686.891,77	0,64
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38	0,35	1,16	1.040.159,11	0,12	667.787.142,21	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,57	-0,38	-0,95	15.902.735,77	1,85	1.140.733.437,19	1,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,35	-0,53	-1,09	444.188.624,78	51,58		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,72	-1,12	-2,32	33.431.329,70	3,88	2.735.100.530,81	1,22
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,72	-1,12	-2,32	33.431.329,70	3,88		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,93	-0,68	-1,01	68.265.470,44	7,93	663.991.044,00	10,28
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,99	-1,16	-2,94	33.208.866,64	3,86	1.490.439.966,72	2,23
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,74	-1,11	-2,31	39.908.726,33	4,63	1.191.682.801,93	3,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,24	0,48	2,38	49.222.208,34	5,72	1.782.480.794,45	2,76
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,49	2,34	13.527.213,32	1,57	3.865.180.591,77	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	3,16	-0,63	0,13	17.923.491,87	2,08	456.449.752,03	3,93
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,05	-0,50	-0,53	222.055.976,94	25,79		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,49	0,64	2,98	8.468.366,73	0,98	4.518.649.732,42	0,19
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,49	0,64	2,98	8.468.366,73	0,98		
Renda Fixa			3,32	-0,53	-0,93	708.144.298,15	82,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

17,76%

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
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	17,87	-2,95	-4,70	9.600.797,96	1,11	1.303.812.974,47	0,74
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	18,41	-0,72	3,48	15.230.955,45	1,77	391.538.918,98	3,89
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	16,14	1,35	6,82	21.282.198,94	2,47	259.394.838,59	8,20
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	20,52	-2,53	-0,59	5.653.144,30	0,66	53.944.663,02	10,48
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,26	-2,44	-2,14	38.771.616,66	4,50	1.191.393.271,47	3,25
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	19,20	-3,07	-3,76	21.667.857,85	2,52	293.743.140,03	7,38
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,80	-2,60	0,62	28.228.695,46	3,28	199.736.999,09	14,13
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	17,86	-4,27	5,31	4.927.995,86	0,57	614.508.879,84	0,80
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,72	-1,95	0,07	145.363.262,48	16,88		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	14,76	3,32	22,73	5.761.718,67	0,67	1.823.132.593,52	0,32
Sub-total Artigo 8º III			14,76	3,32	22,73	5.761.718,67	0,67		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	13,18	-7,15	-18,14	1.847.500,00	0,21	0,00	
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			13,18	-7,15	-18,14	1.847.500,00	0,21		

Renda Variável

17,24 -1,83 0,49 152.972.481,15 17,76

Total

4,83 -0,77 -0,67 861.116.779,30 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	444.188.624,78	51,58	0,00	40,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	33.431.329,70	3,88	0,00	4,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	222.055.976,94	25,79	0,00	15,00	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.468.366,73	0,98	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	708.144.298,15	82,24					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	145.363.262,48	16,88	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	5.761.718,67	0,67	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.847.500,00	0,21	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável	152.972.481,15	17,76					30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,53 -124,25	-1,09 -53,01	-0,39 -35,86	0,42 23,72	2,12 78,58	-2.349.536,81	-4.851.299,71
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,12 -264,65	-2,32 -112,50	-1,08 -99,16	0,10 5,89	3,01 111,46	-379.526,29	-793.200,64
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,50 -118,40	-0,53 -25,84	-0,33 -30,26	0,61 34,25	2,43 90,02	-1.121.435,58	-1.184.419,29
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,64 150,86	2,98 144,43	1,49 136,91	2,62 147,73	3,92 145,08	53.842,17	244.675,52
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,95 0,53	0,07 0,26	-5,56 0,33	6,72 -1,22	14,86 -4,68	-2.895.590,05	94.774,83
Artigo 8º III % do CDI	3,32 783,67	22,73 1.103,35	8,84 812,29	19,84 1.120,22		185.349,10	1.067.066,20
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-7,15 -4,67	-18,14 -17,94	-13,16 -7,27	-18,40 -26,35	-15,10 -34,64	-142.250,00	-411.300,00
CUBATÃO (Total)						-6.649.147,46	-5.833.703,09

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	31.087.128,69	0,00	0,00	0,00	30.735.854,28	-351.274,41	-728.369,86
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	144.854.775,76	4.221.323,96	-1.380.000,00	0,00	148.191.155,03	495.055,31	1.642.756,92
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.036.533,99	0,00	0,00	0,00	1.040.159,11	3.625,12	11.973,99
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	32.407.975,84	0,00	0,00	0,00	32.046.267,47	-361.708,37	-791.462,98
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	20.923.799,83	0,00	0,00	0,00	20.692.743,17	-231.056,66	-506.370,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	63.163.065,81	0,00	0,00	0,00	62.444.823,71	-718.242,10	-1.505.159,45
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.962.952,04	0,00	0,00	0,00	15.902.735,77	-60.216,27	-153.097,47
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.686.573,78	260.000,00	-190.000,00	0,00	44.910.909,12	154.335,34	537.212,39
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	29.293.598,38	0,00	0,00	0,00	28.968.796,30	-324.802,08	-690.000,24
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	60.193.301,90	0,00	0,00	0,00	59.237.993,61	-955.308,29	-2.668.968,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.131,61	0,00	0,00	0,00	17.187,21	55,60	185,98
					444.188.624,78	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	33.810.855,99	0,00	0,00	0,00	33.431.329,70	-379.526,29	-793.200,64
					33.431.329,70	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	40.358.349,34	0,00	0,00	0,00	39.908.726,33	-449.623,01	-945.212,34
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.461.334,41	0,00	0,00	0,00	13.527.213,32	65.878,91	309.009,12
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	68.733.232,77	0,00	0,00	0,00	68.265.470,44	-467.762,33	-699.998,15
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	33.599.666,03	0,00	0,00	0,00	33.208.866,64	-390.799,39	-1.006.471,29
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	18.037.239,20	0,00	0,00	0,00	17.923.491,87	-113.747,33	24.104,69
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	48.532.290,77	455.300,00	0,00	0,00	49.222.208,34	234.617,57	1.134.148,68
					222.055.976,94	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
					0,00	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	8.414.524,56	0,00	0,00	0,00	8.468.366,73	53.842,17	244.675,52
					8.468.366,73	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	20.998.689,97	0,00	0,00	0,00	21.282.198,94	283.508,97	1.358.467,28
4UM SMALL CAPS FIA	15.341.406,93	0,00	0,00	0,00	15.230.955,45	-110.451,48	512.664,47
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	28.983.204,99	0,00	0,00	0,00	28.228.695,46	-754.509,53	174.347,09
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	22.353.543,33	0,00	0,00	0,00	21.667.857,85	-685.685,48	-845.800,17
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	9.892.600,56	0,00	0,00	0,00	9.600.797,96	-291.802,60	-473.833,22
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.799.915,82	0,00	0,00	0,00	5.653.144,30	-146.771,52	-33.425,85
OCCAM FIC FIA	39.741.449,11	0,00	0,00	0,00	38.771.616,66	-969.832,45	-846.020,58
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	5.148.041,82	0,00	0,00	0,00	4.927.995,86	-220.045,96	248.375,81
					145.363.262,48	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5.576.369,57	0,00	0,00	0,00	5.761.718,67	185.349,10	1.067.066,20
					5.761.718,67	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	1.989.750,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.847.500,00	-142.250,00	-411.300,00
						1.847.500,00	0,00	0,00

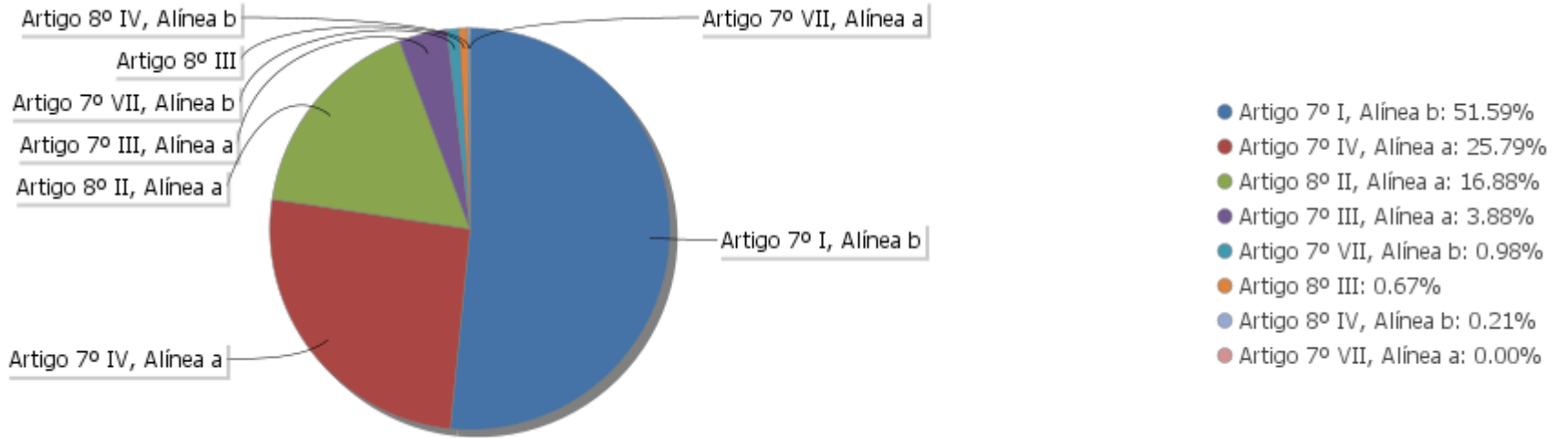
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

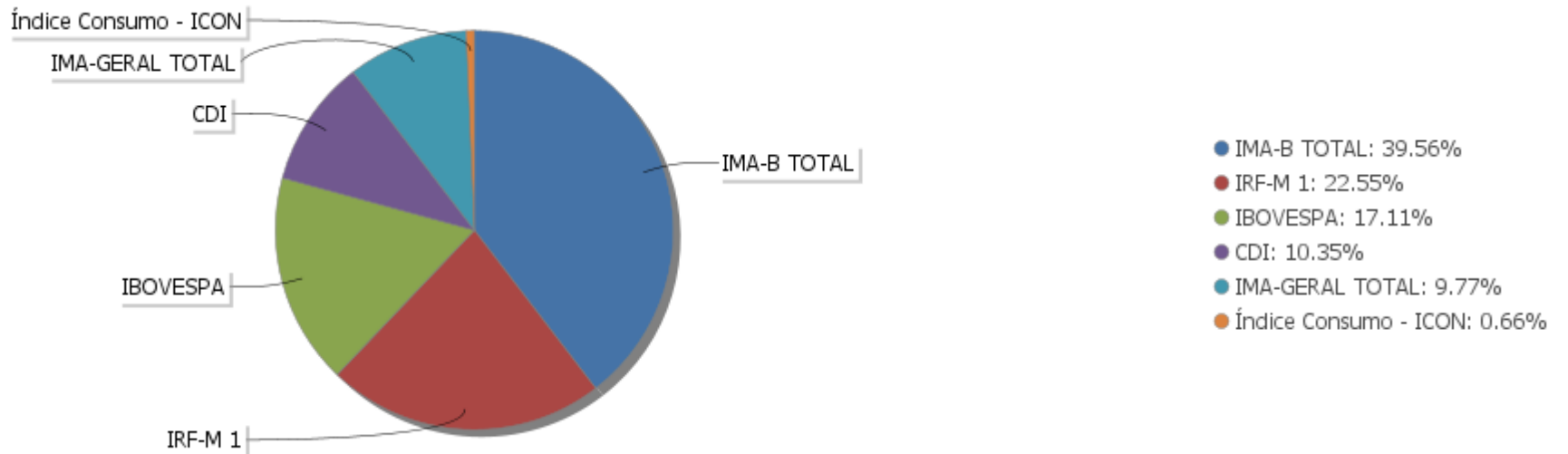
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	856.188.783,44	99,43	856.188.783,44	99,43
de 31 a 365 dias	4.927.995,86	0,57	861.116.779,30	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	861.116.779,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

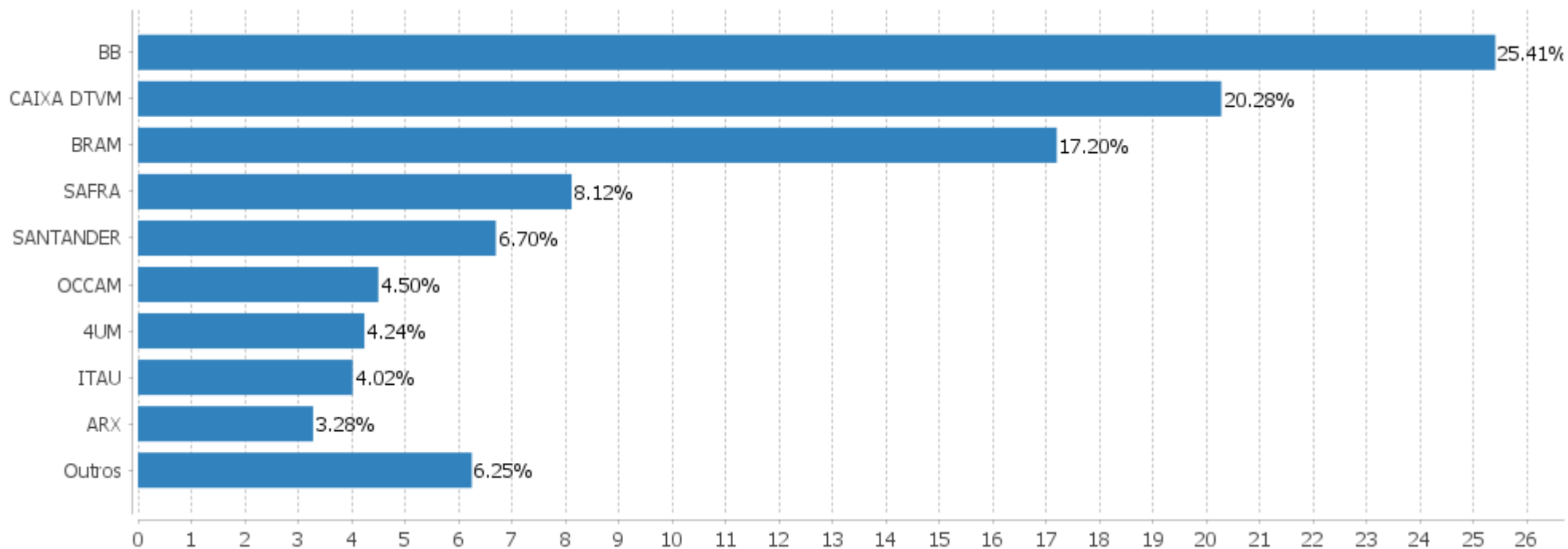


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,95	-1,27	0,53	0,92	1,42	0,34	-0,84	-0,77					-0,67
INPC + 5,86%	0,72	1,23	1,39	0,83	1,44	1,08	1,52	1,38					10,01
p.p. indexador	-1,67	-2,50	-0,86	0,08	-0,02	-0,74	-2,37	-2,15					-10,68
2020	0,23	-0,94	-7,44	1,84	1,81	2,26	3,20	-1,32	-1,40	-0,05	2,65	3,68	4,09
INPC + 5,86%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,60
p.p. indexador	-0,46	-1,52	-8,12	1,61	1,61	1,48	2,24	-2,16	-2,75	-1,42	1,25	1,71	-7,52
2019	3,58	0,24	0,31	1,07	2,11	2,57	1,17	0,27	1,76	2,17	-0,86	2,58	18,27
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,70	-0,76	-0,90	-0,02	1,45	2,12	0,54	-0,36	1,33	1,60	-1,86	0,87	7,49

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	43,75	03 meses	-1,27	4,04	-5,31	4,52
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	56,25	06 meses	1,58	7,89	-6,31	4,60
			12 meses	4,19	16,87	-12,68	4,83
			24 meses	9,33	27,41	-18,08	8,25
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	22,28	36,00	-13,72	7,45
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

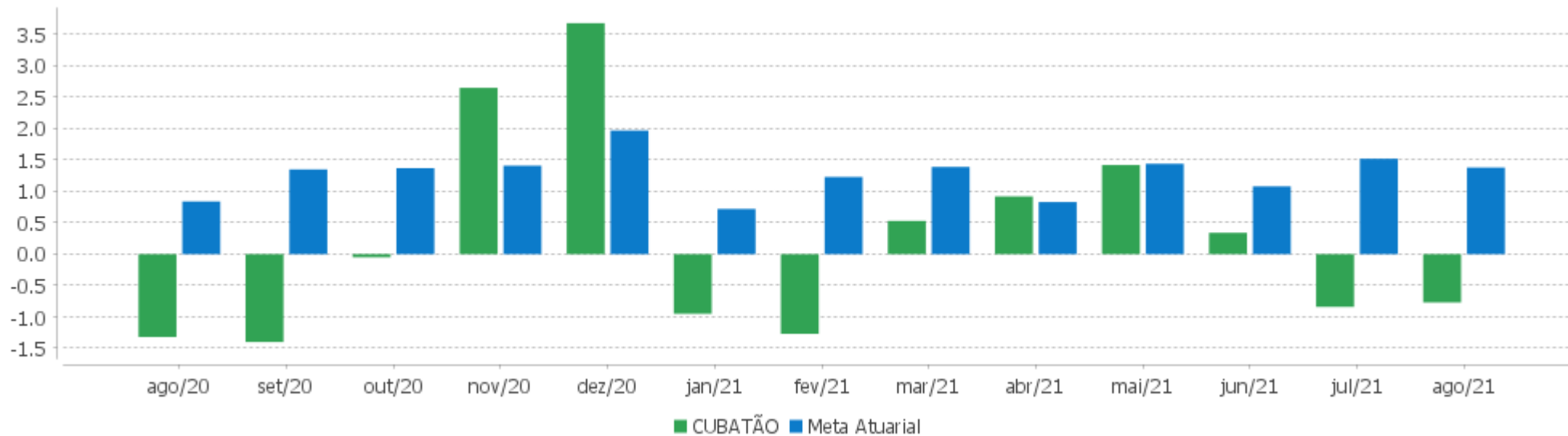


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,14 -0,05	-2,35 -0,18	-1,14 -0,09	0,05 -0,14	3,01 -0,26	9,40 -0,73	39,26 -1,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,11 -0,02	-2,33 -0,16	-1,10 -0,06	0,07 -0,12	2,98 -0,29	9,55 -0,57	39,09 -1,34
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,02	1,16 -0,21	0,75 -0,02	1,15 -0,14	1,87 -0,37	6,72 -0,69	14,37 -0,99
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 -0,03	1,16 -0,22	0,68 -0,09	1,12 -0,17	1,83 -0,40	6,69 -0,72	14,37 -0,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,34 -0,02	1,21 -0,16	0,70 -0,07	1,17 -0,12	2,00 -0,24	6,95 -0,46	14,68 -0,67
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,10 -0,01	-2,39 -0,22	-1,10 -0,06	-0,01 -0,20	2,98 -0,29	9,54 -0,58	39,12 -1,32
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,59 -0,50	-4,31 -2,14	-1,78 -0,74	-0,79 -0,98	0,67 -2,59	8,93 -1,19	42,05 1,61
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,13 -0,04	-2,31 -0,14	-1,14 -0,09	0,07 -0,12	3,03 -0,24	9,60 -0,52	39,38 -1,06
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,38 0,03	-0,95 -0,58	-0,22 -0,06	0,33 -0,24	1,25 -0,62	7,26 -1,24	23,77 -1,90
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,12 -0,03	-2,41 -0,24	-1,13 -0,09	0,00 -0,19	2,90 -0,36	9,37 -0,75	38,97 -1,46
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,32 -0,04	1,09 -0,28	0,67 -0,10	1,10 -0,19	1,67 -0,57	6,29 -1,12	13,78 -1,58
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	-0,63 -148,68	0,13 6,54	-1,18 -108,82	0,73 41,24	3,14 116,12	12,17 182,07	23,92 178,75
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,16 -0,07	-2,94 -0,77	-1,16 -0,12	-0,22 -0,41	2,34 -0,93	9,19 -0,93	39,49 -0,95
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,49 115,39	2,34 113,48	1,23 113,42	2,00 113,12	2,87 106,32	6,21 92,99	12,81 95,73
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,11 -0,02	-2,31 -0,14	-1,10 -0,06	0,09 -0,10	2,93 -0,34	9,37 -0,75	39,01 -1,43
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,48 113,03	2,38 115,60	1,20 110,23	2,08 117,65	3,07 113,42	6,17 92,32	12,84 95,92
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	-0,68	-1,01	-0,63	-0,03	1,46	8,35	25,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,27	-0,64	-0,47	-0,60	-0,41	-0,16	0,02
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,12 -0,03	-2,32 -0,15	-1,08 -0,03	0,10 -0,09	3,01 -0,25	9,46 -0,67	39,11 -1,33
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-93,82 -1.403,84	-98,14 -733,42
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,64 150,86	2,98 144,43	1,49 136,91	2,62 147,73	3,92 145,08	6,67 99,74	13,35 99,74
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS Var. IBOVESPA p.p.	-7,15 -4,67	-18,14 -17,94	-13,16 -7,27	-18,40 -26,35	-15,10 -34,64	-15,33 -32,78	5,61 -49,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	3,32 5,80	22,73 22,93	8,84 14,73	19,84 11,89	30,12 10,58	53,55 36,10	59,83 4,92
GERAÇÃO FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-3,07 -0,59	-3,76 -3,56	-6,47 -0,58	2,77 -5,17	12,89 -6,64	8,55 -8,90	49,80 -5,11
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,60 -0,12	0,62 0,82	-7,05 -1,16	7,76 -0,19			
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,27 -1,80	5,31 5,51	-3,72 2,17	5,83 -2,12	18,03 -1,50	36,83 19,38	
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,72 1,76	3,48 3,68	-4,31 1,58	7,06 -0,89	16,59 -2,94	27,19 9,74	100,69 45,78
ITAU INDEX IBOVESPA 1 Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-2,53 1,37	-0,59 5,31	-6,03 2,31	7,64 6,99	18,85 18,43	16,00 9,81	38,97 -21,83
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,95 -0,47	-4,70 -4,50	-8,30 -2,41	3,10 -4,84	8,30 -11,23	-2,56 -20,01	50,78 -4,13
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,44 0,04	-2,14 -1,94	-6,91 -1,01	4,54 -3,41	13,32 -6,22	14,01 -3,44	66,42 11,51
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,35 3,83	6,82 7,02	0,27 6,16	15,72 7,77	22,88 3,34	18,69 1,24	59,48 4,57
CUBATÃO Var. INPC + 5,86% p.p.	-0,77 -2,15	-0,67 -10,68	-1,27 -5,31	1,58 -6,31	4,19 -12,68	9,33 -18,02	
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	2,00
4UM SMALL CAPS FIA			D+17 du	D+20 du	-	2,00
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	-	
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,25
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,20
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Não se aplica	Não se aplica				
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	-	3,00
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU INDEX IBOVESPA 1	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		0,80
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	Método Passivo.	0,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,30
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,14	35,76

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,15	35,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
164	03/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.760.000,00	0,00	640.420,59308000	2,7481939510
147	03/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	75.000,00	27.290,65027300	2,7481939510
158	03/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	650.000,00	0,00	236.518,96903500	2,7481939510
166	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.000,00	0,00	13.273,13649900	2,6369050000
159	04/08/2021	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	245.000,00	0,00	1.285,94542500	190,5213047000
154	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	225.000,00	0,00	85.327,30606500	2,6369050000
150	04/08/2021	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	210.300,00	0,00	1.103,81356300	190,5213047000
148	06/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.500,00	0,00	1.637,47003100	2,7481418980
157	06/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	638.000,00	0,00	232.156,86222900	2,7481418980
163	13/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	570.000,00	0,00	207.280,35971200	2,7498987400
151	17/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.373,96	0,00	3.407,37699900	2,7510780290
162	18/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	279.000,00	0,00	101.415,99450600	2,7510453490
161	24/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	30.500,00	11.075,16685300	2,7539088490
160	27/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	40.030,00	14.529,02436600	2,7551746760
149	27/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	209.450,00	0,00	76.020,58839400	2,7551746760
156	27/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.234.470,00	448.055,07641800	2,7551746760
153	27/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	62.100,00	23.494,25811500	2,6431990000
165	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.500,00	9.643,96738500	2,6441400000
152	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	102.400,00	38.727,14561500	2,6441400000
155	31/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	101.000,00	0,00	36.638,49005800	2,7566638210
Total			4.936.623,96	1.570.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 18.417.258,85

Value-At-Risk: 2,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CUBATÃO		2,14	2,14			861.116.779,30	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,70%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF		3,02	0,07	0,05			20.692.743,17	2,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		3,01	0,09	0,01			28.968.796,30	3,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,17	0,02	0,01			148.191.155,03	17,21
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		3,21	0,20	0,50			59.237.993,61	6,88
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,03	0,10	0,04			30.735.854,28	3,57
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		3,02	0,10	0,01			32.046.267,47	3,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,02	0,20	0,02			62.444.823,71	7,25
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,16	0,00	0,02			17.187,21	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,00	0,01			44.910.909,12	5,22
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,18	0,00	0,02			1.040.159,11	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,18	0,02	0,09			15.902.735,77	1,85
Sub-total	4,02	1,70	0,79		-0,24	-0,53	444.188.624,78	51,58

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		3,03	0,11	0,04			33.431.329,70	3,88
Sub-total	7,22	3,03	0,11		-0,21	-1,12	33.431.329,70	3,88

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,43	0,10	0,30			68.265.470,44	7,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		3,10	0,11	0,17			33.208.866,64	3,86
BB PREV RF IMA-B		3,03	0,13	0,04			39.908.726,33	4,63
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,04	-0,00	0,04			49.222.208,34	5,72
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	-0,00	0,03			13.527.213,32	1,57
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP		1,97	0,03	1,97			17.923.491,87	2,08
Sub-total	3,89	1,58	0,37		-0,24	-0,50	222.055.976,94	25,79

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,00	NaN	0,00		0,00	NaN	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO		0,07	0,00	0,07			8.468.366,73	0,98
Sub-total	0,37	0,07	0,00		0,59	0,64	8.468.366,73	0,98

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,97%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		6,36	0,06	2,87			9.600.797,96	1,11
4UM SMALL CAPS FIA		6,63	0,07	5,87			15.230.955,45	1,77
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA		6,67	0,12	4,07			21.282.198,94	2,47
ITAU INDEX IBOVESPA 1		7,12	0,04	5,38			5.653.144,30	0,66
OCCAM FIC FIA		7,07	0,25	1,80			38.771.616,66	4,50
GERAÇÃO FI EM AÇÕES		6,41	0,13	1,84			21.667.857,85	2,52
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		6,15	0,16	1,71			28.228.695,46	3,28
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		7,26	0,03	3,97			4.927.995,86	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	15,89	6,15	0,85		-0,15	-1,95	145.363.262,48	16,88

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		5,48	0,02	6,59			5.761.718,67	0,67
Sub-total	8,06	5,48	0,02		0,36	3,32	5.761.718,67	0,67

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS		7,97	0,00	9,68			1.847.500,00	0,21
Sub-total	17,88	7,97	0,00		-0,42	-7,15	1.847.500,00	0,21