



**LDB**  
EMPRESAS

**CUBATÃO**  
SETEMBRO 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 30.09.2021.

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

83,19%

## 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	5,30	-0,17	-2,55	20.658.425,25	2,41	389.893.763,12	5,30
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,30	-0,15	-2,47	28.925.219,94	3,37	461.408.407,40	6,27
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,37	1,53	153.316.529,79	17,88	6.892.529.188,23	2,22
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,19	-0,62	-4,91	58.868.351,85	6,86	706.154.183,31	8,34
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	30.688.658,21	3,58	7.233.196.021,39	0,42
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,31	-0,16	-2,57	31.994.535,40	3,73	649.147.051,80	4,93
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	-0,16	-2,51	62.347.549,67	7,27	5.161.580.539,44	1,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,36	1,46	17.248,97	0,00	38.250.825,09	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	1,59	45.147.542,44	5,26	6.805.654.314,46	0,66
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,41	0,39	1,56	1.044.229,67	0,12	665.519.143,94	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	-0,02	-0,97	15.900.063,09	1,85	1.024.096.956,96	1,55
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,12</b>	<b>0,02</b>	<b>-1,07</b>	<b>448.908.354,28</b>	<b>52,34</b>		

## 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	5,31	-0,14	-2,46	33.383.696,41	3,89	2.639.799.894,69	1,26
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>5,31</b>	<b>-0,14</b>	<b>-2,46</b>	<b>33.383.696,41</b>	<b>3,89</b>		

## 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	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,79	-0,06	-1,08	68.221.142,57	7,95	540.162.479,42	12,63
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,55	-0,20	-3,14	33.141.448,21	3,86	1.126.747.978,22	2,94
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,32	-0,13	-2,44	39.856.776,22	4,65	1.163.721.806,55	3,42

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	0,50	2,89	49.468.488,42	5,77	1.511.125.433,54	3,27
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,49	2,84	13.593.833,13	1,58	3.692.592.328,71	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	3,09	0,71	0,85	18.051.347,49	2,10	440.890.853,26	4,09
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,86</b>	<b>0,12</b>	<b>-0,41</b>	<b>222.333.036,04</b>	<b>25,92</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	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,49	0,57	3,57	8.863.366,46	1,03	5.024.777.639,16	0,18
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>0,49</b>	<b>0,57</b>	<b>3,57</b>	<b>8.863.366,46</b>	<b>1,03</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,10</b>	<b>0,05</b>	<b>-0,88</b>	<b>713.488.453,19</b>	<b>83,19</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL

16,81%

## 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	18,09	-6,61	-11,00	8.966.559,73	1,05	1.127.988.215,22	0,79
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	18,65	-5,67	-2,38	14.368.072,29	1,68	379.646.948,48	3,78
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	16,76	-5,17	1,30	20.182.358,23	2,35	241.299.748,54	8,36
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	20,96	-6,63	-7,18	5.278.555,21	0,62	48.832.663,97	10,81
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,34	-6,93	-8,92	36.085.613,28	4,21	1.069.194.291,65	3,38
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	19,44	-6,38	-9,90	20.284.787,53	2,37	274.249.558,39	7,40
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,65	-3,60	-3,00	27.212.941,81	3,17	233.058.116,05	11,68
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	18,53	-8,94	-4,10	4.487.554,56	0,52	562.068.638,43	0,80
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>18,10</b>	<b>-5,85</b>	<b>-5,78</b>	<b>136.866.442,64</b>	<b>15,96</b>		

## 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	13,77	-4,57	17,12	5.498.363,79	0,64	1.884.756.886,81	0,29
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>13,77</b>	<b>-4,57</b>	<b>17,12</b>	<b>5.498.363,79</b>	<b>0,64</b>		

## 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	13,47	0,00	-18,14	1.835.000,00	0,21	0,00	
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>13,47</b>	<b>0,00</b>	<b>-18,14</b>	<b>1.835.000,00</b>	<b>0,21</b>		

## Renda Variável

17,57

-5,73

-5,26

144.199.806,43

16,81

## Total

4,73

-0,97

-1,63

857.688.259,62

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	448.908.354,28	52,34	0,00	40,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	33.383.696,41	3,89	0,00	4,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	222.333.036,04	25,92	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"	8.863.366,46	1,03	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>713.488.453,19</b>	<b>83,19</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	136.866.442,64	15,96	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	5.498.363,79	0,64	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.835.000,00	0,21	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>144.199.806,43</b>	<b>16,81</b>					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	0,02 4,00	-1,07 -42,86	-0,68 -55,67	0,76 37,69	3,00 100,39	81.704,69	-4.769.595,02
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,14 -32,51	-2,46 -97,99	-1,64 -134,42	0,45 22,55	4,47 149,56	-47.633,29	-840.833,93
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,12 28,47	-0,41 -16,28	-0,53 -43,68	1,05 51,89	3,26 108,98	277.059,10	-907.360,19
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,57 130,99	3,57 142,24	1,67 136,26	2,92 144,93	4,35 145,59	50.299,73	294.975,25
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,85 0,72	-5,78 0,97	-11,46 1,02	-4,11 0,74	14,01 -3,30	-8.496.819,84	-8.402.045,01
Artigo 8º III % do CDI	-4,57 -1.043,03	17,12 682,80	1,15 93,90	9,89 490,98		-263.354,88	803.711,32
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,00 6,57	-18,14 -11,38	-5,07 7,41	-13,26 -8,41	-15,74 -33,05	0,00	-411.300,00
<b>CUBATÃO (Total)</b>						<b>-8.398.744,49</b>	<b>-14.232.447,58</b>

## 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	30.735.854,28	0,00	0,00	0,00	30.688.658,21	-47.196,07	-775.565,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	148.191.155,03	10.152.144,81	-5.580.110,00	0,00	153.316.529,79	553.339,95	2.196.096,87
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.040.159,11	0,00	0,00	0,00	1.044.229,67	4.070,56	16.044,55
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	32.046.267,47	0,00	0,00	0,00	31.994.535,40	-51.732,07	-843.195,05
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	20.692.743,17	0,00	0,00	0,00	20.658.425,25	-34.317,92	-540.688,12
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.444.823,71	0,00	0,00	0,00	62.347.549,67	-97.274,04	-1.602.433,49
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.902.735,77	0,00	0,00	0,00	15.900.063,09	-2.672,68	-155.770,15
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.910.909,12	293.400,00	-227.410,00	0,00	45.147.542,44	170.643,32	707.855,71
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	28.968.796,30	0,00	0,00	0,00	28.925.219,94	-43.576,36	-733.576,60
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	59.237.993,61	0,00	0,00	0,00	58.868.351,85	-369.641,76	-3.038.610,55

**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	17.187,21	0,00	0,00	0,00	17.248,97	61,76	247,74
					448.908.354,28	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	33.431.329,70	0,00	0,00	0,00	33.383.696,41	-47.633,29	-840.833,93
					33.383.696,41	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	39.908.726,33	0,00	0,00	0,00	39.856.776,22	-51.950,11	-997.162,45
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.527.213,32	0,00	0,00	0,00	13.593.833,13	66.619,81	375.628,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	68.265.470,44	0,00	0,00	0,00	68.221.142,57	-44.327,87	-744.326,02
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	33.208.866,64	0,00	0,00	0,00	33.141.448,21	-67.418,43	-1.073.889,72
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	17.923.491,87	0,00	0,00	0,00	18.051.347,49	127.855,62	151.960,31
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	49.222.208,34	0,00	0,00	0,00	49.468.488,42	246.280,08	1.380.428,76
					222.333.036,04	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	8.468.366,73	344.700,00	0,00	0,00	8.863.366,46	50.299,73	294.975,25
					8.863.366,46	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	21.282.198,94	0,00	0,00	0,00	20.182.358,23	-1.099.840,71	258.626,57
4UM SMALL CAPS FIA	15.230.955,45	0,00	0,00	0,00	14.368.072,29	-862.883,16	-350.218,69
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	28.228.695,46	0,00	0,00	0,00	27.212.941,81	-1.015.753,65	-841.406,56
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	21.667.857,85	0,00	0,00	0,00	20.284.787,53	-1.383.070,32	-2.228.870,49
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	9.600.797,96	0,00	0,00	0,00	8.966.559,73	-634.238,23	-1.108.071,45
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.653.144,30	0,00	0,00	0,00	5.278.555,21	-374.589,09	-408.014,94
OCCAM FIC FIA	38.771.616,66	0,00	0,00	0,00	36.085.613,28	-2.686.003,38	-3.532.023,96
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.927.995,86	0,00	0,00	0,00	4.487.554,56	-440.441,30	-192.065,49
					136.866.442,64	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	5.761.718,67	0,00	0,00	0,00	5.498.363,79	-263.354,88	803.711,32
					5.498.363,79	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	1.847.500,00	0,00	0,00	0,00	12.500,00	1.835.000,00	0,00	-411.300,00
						1.835.000,00	0,00	0,00

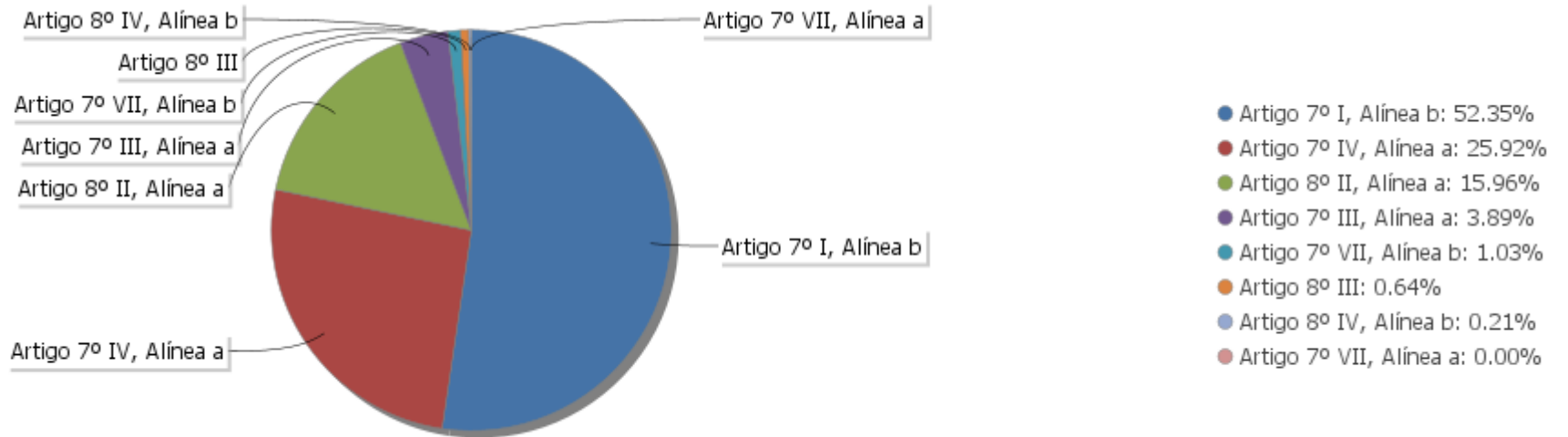
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

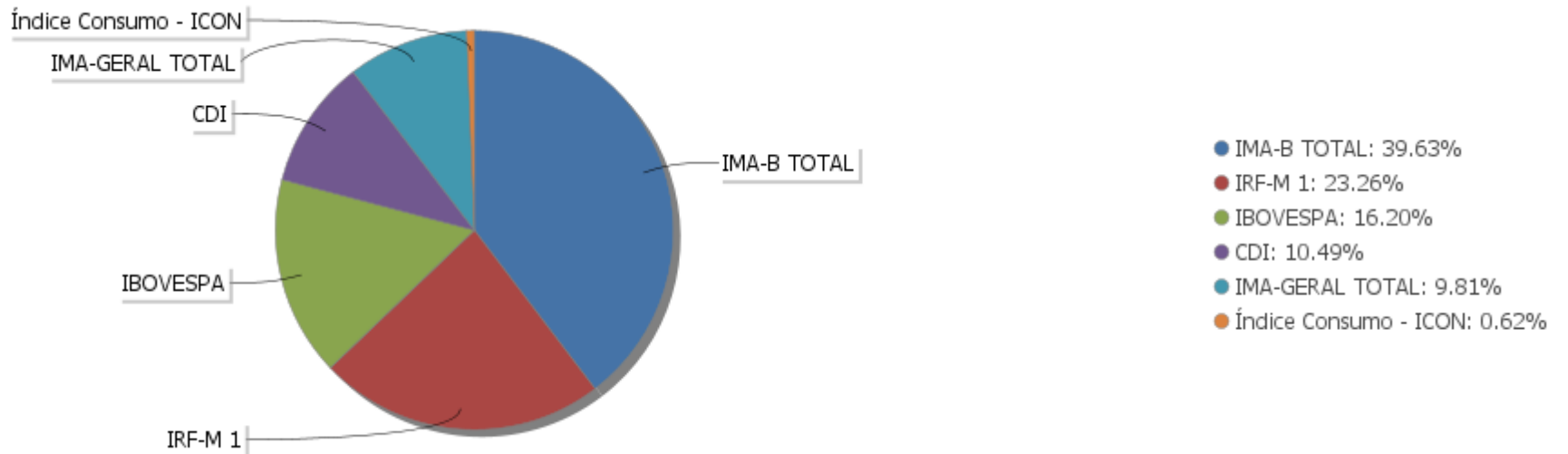
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	853.200.705,06	99,48	853.200.705,06	99,48
de 31 a 365 dias	4.487.554,56	0,52	857.688.259,62	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	857.688.259,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

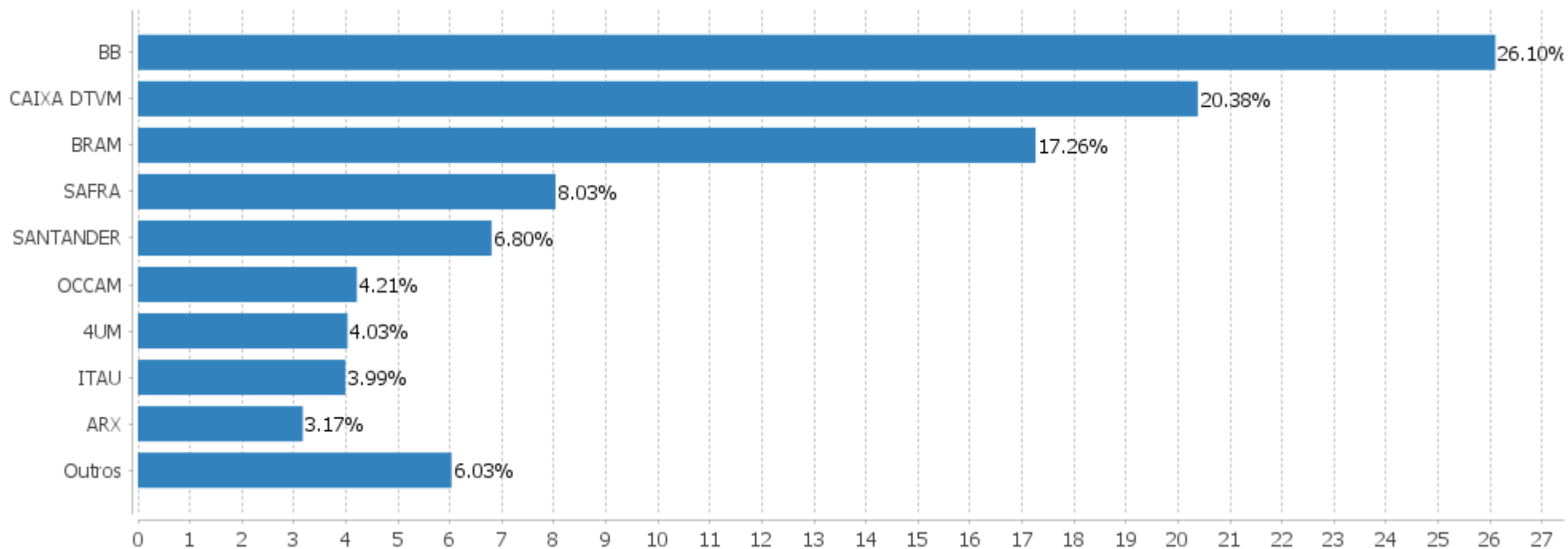


Alocação Por Estratégia



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	-0,97				-1,63
INPC + 5,86%	0,72	1,23	1,39	0,83	1,44	1,08	1,52	1,38	1,68				11,86
p.p. indexador	-1,67	-2,50	-0,86	0,08	-0,02	-0,74	-2,37	-2,15	-2,65				-13,49
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

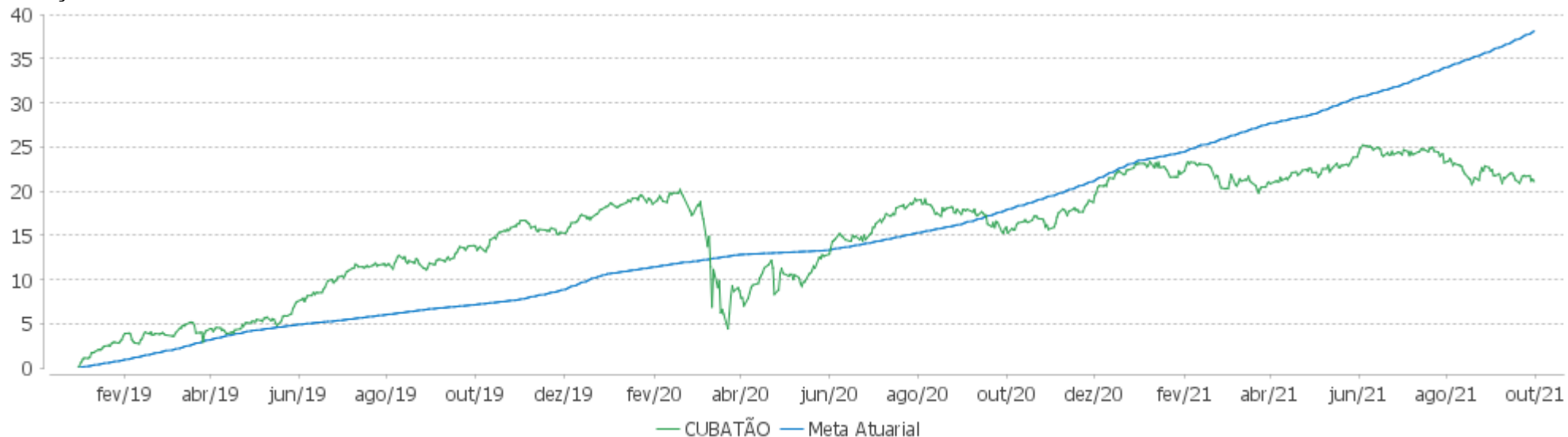
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	42,42	03 meses	-2,56	4,66	-7,22	4,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	57,58	06 meses	0,06	8,21	-8,14	4,48
			12 meses	4,64	17,25	-12,61	4,73
			24 meses	6,39	28,99	-22,60	8,29
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	21,09	38,29	-17,20	7,40
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução**

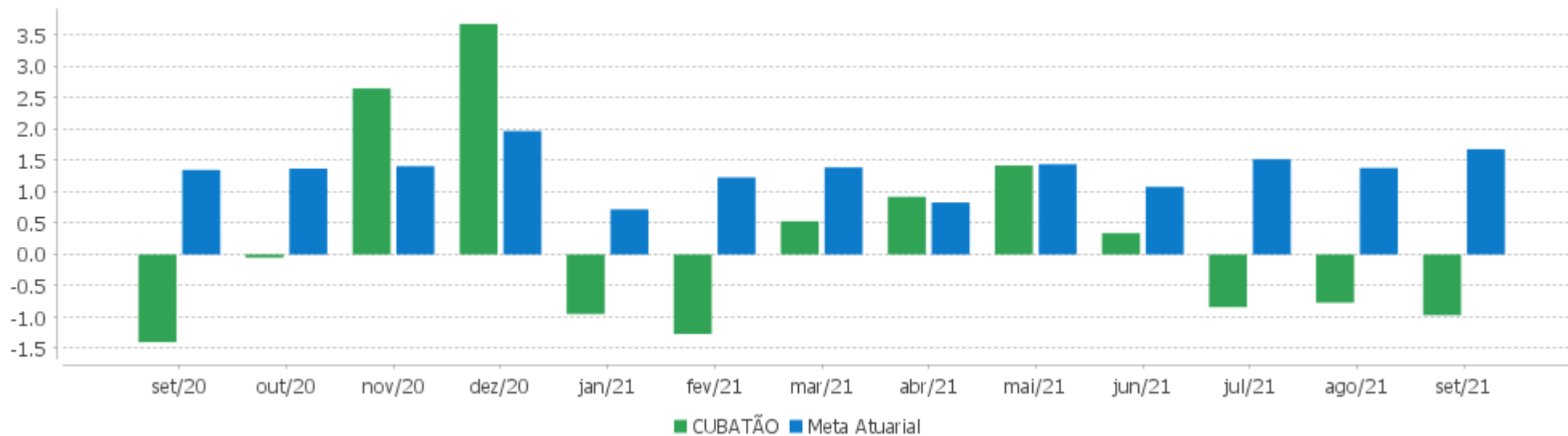


**Patrimônio Líquido**



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
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14 -0,01	-2,46 -0,16	-1,64 -0,05	0,45 -0,07	4,47 -0,24	6,28 -0,64	39,09 -1,37
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,57 130,99	3,57 142,24	1,67 136,26	2,92 144,93	4,35 145,59	6,77 101,80	13,47 100,92
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	0,71 162,78	0,85 33,86	-0,36 -29,23	1,20 59,48	4,05 135,55	11,07 166,37	23,84 178,57
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,20 -0,07	-3,14 -0,84	-1,80 -0,21	0,31 -0,21	3,79 -0,92	5,90 -1,02	39,52 -0,94
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,49 112,38	2,84 113,34	1,38 112,49	2,28 113,27	3,26 109,08	6,25 93,96	12,84 96,20
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 0,00	-2,44 -0,14	-1,62 -0,03	0,46 -0,06	4,43 -0,28	6,22 -0,70	39,06 -1,40
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,06 -0,06	-1,08 -0,70	-1,04 -0,52	0,54 -0,42	1,92 -0,55	6,71 -0,22	24,84 -0,03
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,50 114,18	2,89 115,41	1,37 111,87	2,34 116,33	3,53 118,19	6,21 93,33	12,88 96,46
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	-92,31 -1.387,35	-98,03 -734,45
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,47 -0,17	-1,64 -0,05	0,40 -0,12	4,43 -0,28	6,37 -0,54	39,14 -1,32
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,02	-2,51 -0,21	-1,68 -0,09	0,37 -0,15	4,45 -0,26	6,20 -0,72	39,29 -1,17
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,01	1,56 -0,22	0,94 -0,02	1,54 -0,11	2,24 -0,25	6,47 -0,68	14,11 -1,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,37 -0,04	1,53 -0,25	0,87 -0,09	1,47 -0,18	2,16 -0,33	6,42 -0,73	14,11 -1,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,46 -0,16	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,17 -0,03	-2,55 -0,25	-1,66 -0,07	0,32 -0,20	4,34 -0,37	6,33 -0,59	39,13 -1,33
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,62	-4,91	-2,80	-0,57	2,21	5,16	41,24

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49	-2,61	-1,21	-1,09	-2,50	-1,76	0,78
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,02 -0,01	-0,97 -0,59	-0,53 -0,01	0,71 -0,25	1,85 -0,63	5,72 -1,21	23,04 -1,83
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,03	-2,57 -0,27	-1,68 -0,09	0,34 -0,18	4,34 -0,37	6,19 -0,73	39,01 -1,45
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,36 -0,04	1,46 -0,32	0,86 -0,10	1,46 -0,19	2,17 -0,32	6,03 -1,11	13,53 -1,59
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS Var. IBOVESPA p.p.	0,00 6,57	-18,14 -11,38	-5,07 7,41	-13,26 -8,41	-15,74 -33,05	-12,66 -18,61	6,22 -33,66
GERAÇÃO FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-6,38 0,19	-9,90 -3,15	-12,55 -0,07	-4,99 -0,14	10,51 -6,80	-0,30 -6,25	34,84 -5,03
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,60 2,97	-3,00 3,75	-10,77 1,70	-3,58 1,27			
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,67 0,90	-2,38 4,37	-12,68 -0,20	-2,81 2,04	14,55 -2,76	16,04 10,09	96,16 56,29
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,94 -2,37	-4,10 2,65	-15,00 -2,53	-4,29 0,56	13,06 -4,25	21,82 15,87	
ITAU INDEX IBOVESPA 1 Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-6,63 -0,68	-7,18 4,32	-12,61 1,72	-5,14 2,35	16,60 18,27	4,65 7,35	29,07 -21,41
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,93 -0,36	-8,92 -2,16	-12,94 -0,46	-6,39 -1,54	11,87 -5,44	5,28 -0,67	48,86 8,98
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,61 -0,04	-11,00 -4,24	-13,82 -1,34	-8,35 -3,50	6,94 -10,37	-11,33 -17,28	40,12 0,24
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,17 1,40	1,30 8,05	-5,08 7,39	1,96 6,81	22,88 5,57	11,34 5,39	53,10 13,23
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-4,57 2,00	17,12 23,87	1,15 13,63	9,89 14,74	30,43 13,12	43,41 37,46	51,80 11,93
CUBATÃO Var. INPC + 5,86% p.p.	-0,97 -2,65	-1,63 -13,49	-2,56 -7,22	0,06 -8,14	4,64 -12,61	6,39 -22,55	
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

## 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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

**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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

**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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
182	03/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.676.000,00	0,00	607.781,25690800	2,7575710520
177	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.000,00	0,00	17.009,93342300	2,6455130000
173	03/09/2021	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	344.700,00	0,00	1.550,05017000	222,3798989000
192	03/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	786.000,00	0,00	285.033,45341900	2,7575710520
187	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	245.000,00	0,00	92.609,63752500	2,6455130000
172	03/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	75.000,00	27.197,84860900	2,7575710520
168	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.400,00	0,00	1.285,19496900	2,6455130000
176	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.620,00	2.126,45762600	2,6428930000
191	09/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	629.000,00	0,00	228.332,11742800	2,7547591950
186	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.920,00	10.942,55411500	2,6428930000
171	09/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.200,00	0,00	1.524,63417000	2,7547591950
181	14/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	572.000,00	0,00	207.254,33770600	2,7598939850
175	15/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.600,00	604,19901000	2,6481340000
180	17/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	281.000,00	0,00	101.765,47291000	2,7612508640
183	21/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.974,81	0,00	3.610,04317600	2,7630722160
170	22/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.326.000,00	479.787,64381800	2,7637226950
179	23/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	106.000,00	0,00	38.345,19972300	2,7643616610
190	23/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	197.000,00	0,00	71.264,19193900	2,7643616610
178	28/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	179.110,00	64.768,41721700	2,7653910300
189	28/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.446.450,05231000	2,7653910300
185	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	65.800,00	24.800,62510600	2,6531590000
169	28/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	196.270,00	0,00	70.973,68794100	2,7653910300
174	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.010,00	10.176,88796700	2,6540530000
188	29/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.694.700,00	0,00	2.058.597,30292200	2,7663011080
184	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	95.530,00	35.994,00769400	2,6540530000
167	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.930,00	1.103,97178000	2,6540530000
<b>Total</b>			<b>10.790.244,81</b>	<b>5.807.520,00</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 20.028.961,34

Value-At-Risk: 2,34%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CUBATÃO		2,34	2,34			857.688.259,62	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,64%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF		2,95	0,06	0,04			20.658.425,25	2,41
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,95	0,09	0,01			28.925.219,94	3,37
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,18	0,01	0,01			153.316.529,79	17,88
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		3,12	0,19	0,45			58.868.351,85	6,86
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,97	0,09	0,04			30.688.658,21	3,58
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,96	0,10	0,00			31.994.535,40	3,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,19	0,02			62.347.549,67	7,27
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,18	0,00	0,02			17.248,97	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,18	0,00	0,00			45.147.542,44	5,26
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,19	0,00	0,01			1.044.229,67	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,16	0,02	0,09			15.900.063,09	1,85
<b>Sub-total</b>	2,44	1,62	0,74		-0,17	0,02	448.908.354,28	52,34

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,97	0,10	0,05			33.383.696,41	3,89
<b>Sub-total</b>	4,63	2,97	0,10		-0,13	-0,14	33.383.696,41	3,89

Artigo 7º IV, Alínea a

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,39	0,09	0,20			68.221.142,57	7,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		3,03	0,10	0,23			33.141.448,21	3,86
BB PREV RF IMA-B		2,96	0,12	0,05			39.856.776,22	4,65
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			49.468.488,42	5,77
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP		0,04	-0,00	0,03			13.593.833,13	1,58
		1,94	0,03	1,94			18.051.347,49	2,10
<b>Sub-total</b>	2,27	1,54	0,35		-0,14	0,12	222.333.036,04	25,92

Artigo 7º VII, Alínea a

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

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO		0,05	0,00	0,05			8.863.366,46	1,03
<b>Sub-total</b>	0,14	0,05	0,00		0,99	0,57	8.863.366,46	1,03

## Renda Variável

Value-At-Risk: 7,92%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		8,13	0,07	3,66			8.966.559,73	1,05
4UM SMALL CAPS FIA		8,25	0,10	6,67			14.368.072,29	1,68
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA		6,80	0,13	5,11			20.182.358,23	2,35
ITAU INDEX IBOVESPA 1		10,08	0,05	5,62			5.278.555,21	0,62
OCCAM FIC FIA		9,59	0,33	2,29			36.085.613,28	4,21
GERAÇÃO FI EM AÇÕES		8,74	0,18	2,09			20.284.787,53	2,37
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		8,48	0,23	2,43			27.212.941,81	3,17
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		9,10	0,04	4,85			4.487.554,56	0,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	23,71	8,18	1,13		-0,26	-5,85	136.866.442,64	15,96

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,19	0,02	8,55			5.498.363,79	0,64
<b>Sub-total</b>	12,86	6,19	0,02		-0,39	-4,57	5.498.363,79	0,64

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS		8,27	0,00	11,85			1.835.000,00	0,21
<b>Sub-total</b>	16,97	8,27	0,00		-0,03	0,00	1.835.000,00	0,21