



**LDB**  
EMPRESAS

**CUBATÃO**  
OUTUBRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.10.2021.

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 83,74%

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	5,58	-2,56	-5,05	20.129.296,53	2,40	365.900.196,82	5,50
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,58	-2,56	-4,97	28.186.114,51	3,36	437.560.103,51	6,44
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	-0,52	1,00	151.238.267,85	18,05	6.857.913.148,95	2,21
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,40	-3,25	-8,00	56.953.483,42	6,80	629.292.934,12	9,05
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,61	-2,58	-4,98	29.896.213,79	3,57	6.948.438.281,62	0,43
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,59	-2,58	-5,08	31.168.748,46	3,72	609.574.848,27	5,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,59	-2,56	-5,00	60.750.430,85	7,25	4.811.776.336,97	1,26
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,49	0,96	17.164,93	0,00	37.410.847,65	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,54	1,05	44.910.373,95	5,36	6.589.712.896,46	0,68
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,58	-0,55	1,01	1.038.535,05	0,12	625.705.942,27	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,61	-1,44	-2,39	15.671.790,91	1,87	1.005.905.268,08	1,56
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,31</b>	<b>-1,70</b>	<b>-2,75</b>	<b>439.960.420,25</b>	<b>52,50</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	5,59	-2,55	-4,95	32.531.247,87	3,88	2.549.734.484,26	1,28
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>5,59</b>	<b>-2,55</b>	<b>-4,95</b>	<b>32.531.247,87</b>	<b>3,88</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	3,00	-1,57	-2,63	67.149.110,38	8,01	512.019.971,21	13,11
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,80	-2,65	-5,71	32.263.251,93	3,85	996.657.609,56	3,24
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,61	-2,59	-4,97	38.824.379,58	4,63	1.089.006.458,36	3,57

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	0,14	0,60	3,51	50.073.454,34	5,97	1.527.024.616,05	3,28
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,19	0,58	3,44	13.672.644,49	1,63	3.647.662.584,07	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	3,35	-1,48	-0,64	17.784.314,89	2,12	424.928.728,08	4,19
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,02</b>	<b>-1,29</b>	<b>-1,69</b>	<b>219.767.155,61</b>	<b>26,22</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	0,65	4,24	9.523.862,92	1,14	5.485.196.761,09	0,17
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>0,49</b>	<b>0,65</b>	<b>4,24</b>	<b>9.523.862,92</b>	<b>1,14</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,28</b>	<b>-1,58</b>	<b>-2,44</b>	<b>701.782.686,65</b>	<b>83,74</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL

16,26%

## 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	18,56	-6,96	-17,20	8.342.173,62	1,00	1.037.994.854,41	0,80
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	19,57	-5,37	-7,62	13.596.365,58	1,62	358.126.713,51	3,80
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	17,11	-3,55	-2,30	19.465.182,84	2,32	230.609.605,21	8,44
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	20,96	-6,78	-13,47	4.920.536,69	0,59	45.055.146,43	10,92
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,08	-4,90	-13,38	34.318.106,98	4,09	1.013.856.434,24	3,38
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	19,47	-6,70	-15,94	18.925.837,85	2,26	255.012.629,04	7,42
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,17	-6,83	-9,62	25.355.067,19	3,03	217.608.349,13	11,65
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	20,76	-16,09	-19,54	3.765.382,80	0,45	465.036.411,36	0,81
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>18,30</b>	<b>-5,98</b>	<b>-11,41</b>	<b>128.688.653,55</b>	<b>15,36</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	13,06	7,55	25,96	5.913.265,88	0,71	2.076.640.371,16	0,28
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>13,06</b>	<b>7,55</b>	<b>25,96</b>	<b>5.913.265,88</b>	<b>0,71</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	13,64	-6,72	-23,64	1.700.000,00	0,20	0,00	
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>13,64</b>	<b>-6,72</b>	<b>-23,64</b>	<b>1.700.000,00</b>	<b>0,20</b>		

## Renda Variável

17,70 -5,47 -10,44 136.301.919,43 16,26

## Total

4,89 -2,23 -3,83 838.084.606,08 100,00

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	439.960.420,25	52,50	0,00	40,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	32.531.247,87	3,88	0,00	4,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	219.767.155,61	26,22	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"	9.523.862,92	1,14	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>701.782.686,65</b>	<b>83,74</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	128.688.653,55	15,36	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	5.913.265,88	0,71	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.700.000,00	0,20	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>136.301.919,43</b>	<b>16,26</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	-1,70 -353,38	-2,75 -91,81	-2,20 -163,00	-1,40 -60,92	1,16 34,93	-7.689.188,92	-12.458.783,94
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-2,55 -531,54	-4,95 -164,93	-3,78 -280,60	-2,72 -118,67	1,61 48,35	-852.448,54	-1.693.282,47
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,29 -268,71	-1,69 -56,47	-1,66 -123,37	-0,82 -35,94	1,79 53,84	-2.874.220,43	-3.781.580,62
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,65 134,48	4,24 141,19	1,87 138,75	3,19 138,99	4,79 144,16	60.496,46	355.471,71
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,98 0,76	-11,41 1,62	-13,20 1,82	-12,30 0,64	8,38 -1,78	-8.177.789,09	-16.579.834,10
Artigo 8º III % do CDI	7,55 1.570,78	25,96 865,33	6,04 447,93	12,17 531,00		414.902,09	1.218.613,41
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-6,72 0,02	-23,64 -10,60	-13,39 1,64	-19,04 -6,10	-18,68 -28,84	-122.500,00	-533.800,00
<b>CUBATÃO (Total)</b>						<b>-19.240.748,43</b>	<b>-33.473.196,01</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	30.688.658,21	0,00	0,00	0,00	29.896.213,79	-792.444,42	-1.568.010,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	153.316.529,79	3.650.964,89	-4.915.330,00	0,00	151.238.267,85	-813.896,83	1.382.200,04
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.044.229,67	0,00	0,00	0,00	1.038.535,05	-5.694,62	10.349,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	31.994.535,40	0,00	0,00	0,00	31.168.748,46	-825.786,94	-1.668.981,99
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	20.658.425,25	0,00	0,00	0,00	20.129.296,53	-529.128,72	-1.069.816,84
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.347.549,67	0,00	0,00	0,00	60.750.430,85	-1.597.118,82	-3.199.552,31
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.900.063,09	0,00	0,00	0,00	15.671.790,91	-228.272,18	-384.042,33
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.147.542,44	242.000,00	-236.380,00	0,00	44.910.373,95	-242.788,49	465.067,22
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	28.925.219,94	0,00	0,00	0,00	28.186.114,51	-739.105,43	-1.472.682,03
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	58.868.351,85	0,00	0,00	0,00	56.953.483,42	-1.914.868,43	-4.953.478,98

**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	17.248,97	0,00	0,00	0,00	17.164,93	-84,04	163,70
					439.960.420,25	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	33.383.696,41	0,00	0,00	0,00	32.531.247,87	-852.448,54	-1.693.282,47
					32.531.247,87	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	39.856.776,22	0,00	0,00	0,00	38.824.379,58	-1.032.396,64	-2.029.559,09
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.593.833,13	0,00	0,00	0,00	13.672.644,49	78.811,36	454.440,29
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	68.221.142,57	0,00	0,00	0,00	67.149.110,38	-1.072.032,19	-1.816.358,21
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	33.141.448,21	0,00	0,00	0,00	32.263.251,93	-878.196,28	-1.952.086,00
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	18.051.347,49	0,00	0,00	0,00	17.784.314,89	-267.032,60	-115.072,29
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	49.468.488,42	308.340,00	0,00	0,00	50.073.454,34	296.625,92	1.677.054,68
					219.767.155,61	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	8.863.366,46	600.000,00	0,00	0,00	9.523.862,92	60.496,46	355.471,71
					9.523.862,92	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	20.182.358,23	0,00	0,00	0,00	19.465.182,84	-717.175,39	-458.548,82
4UM SMALL CAPS FIA	14.368.072,29	0,00	0,00	0,00	13.596.365,58	-771.706,71	-1.121.925,40
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	27.212.941,81	0,00	0,00	0,00	25.355.067,19	-1.857.874,62	-2.699.281,18
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	20.284.787,53	0,00	0,00	0,00	18.925.837,85	-1.358.949,68	-3.587.820,17
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8.966.559,73	0,00	0,00	0,00	8.342.173,62	-624.386,11	-1.732.457,56
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.278.555,21	0,00	0,00	0,00	4.920.536,69	-358.018,52	-766.033,46
OCCAM FIC FIA	36.085.613,28	0,00	0,00	0,00	34.318.106,98	-1.767.506,30	-5.299.530,26
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.487.554,56	0,00	0,00	0,00	3.765.382,80	-722.171,76	-914.237,25
					128.688.653,55	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	5.498.363,79	0,00	0,00	0,00	5.913.265,88	414.902,09	1.218.613,41
					5.913.265,88	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	1.835.000,00	0,00	0,00	0,00	12.500,00	1.700.000,00	-122.500,00	-533.800,00
						1.700.000,00	0,00	0,00

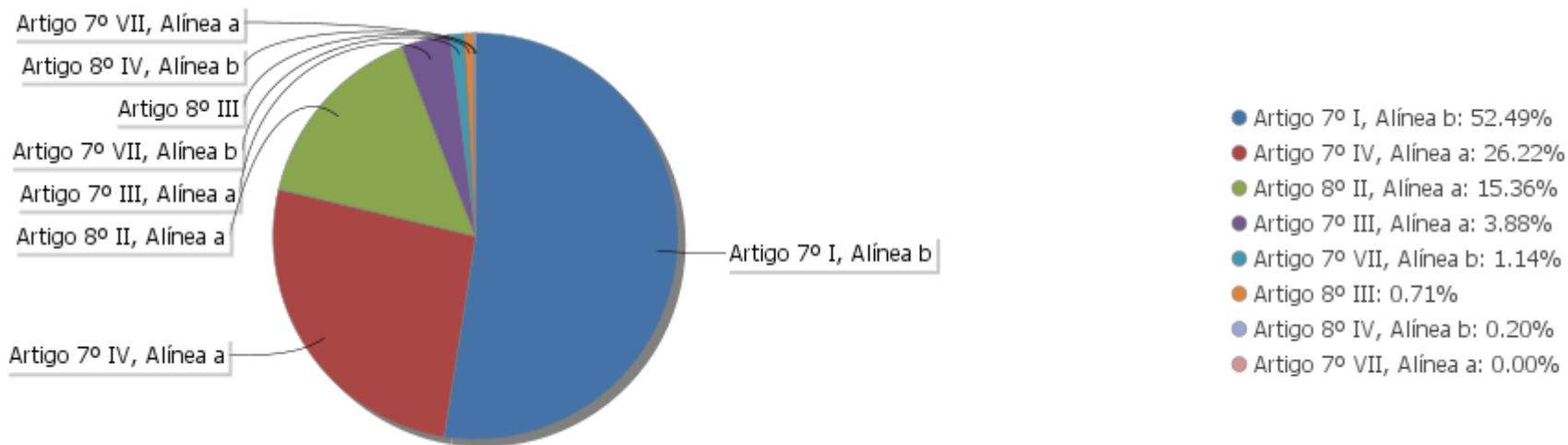
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

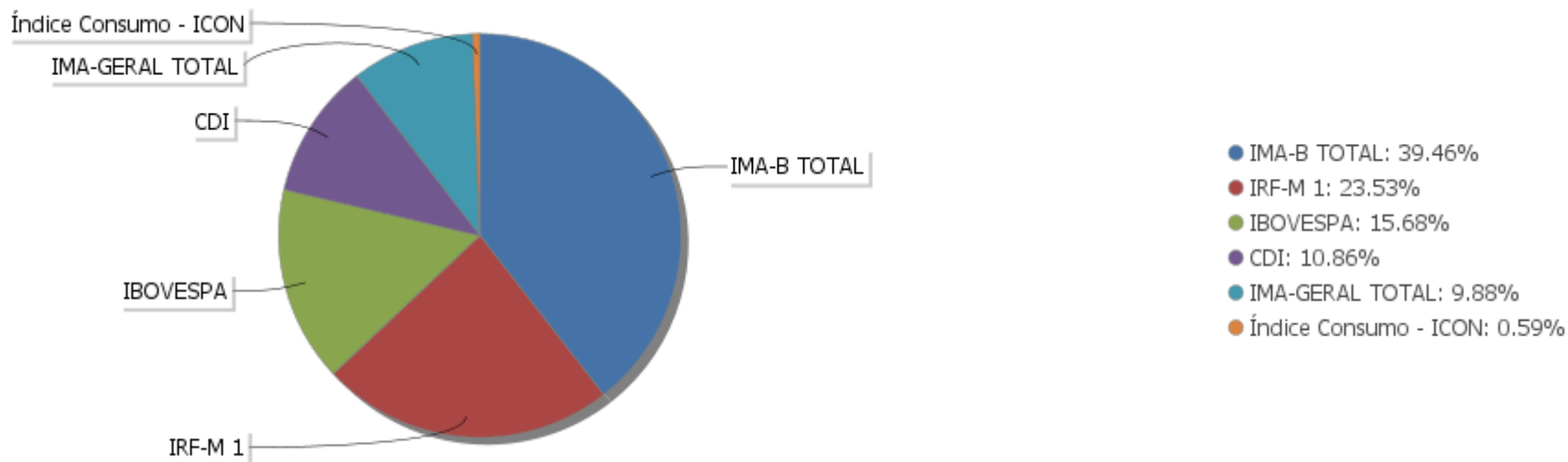
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	834.319.223,28	99,55	834.319.223,28	99,55
de 31 a 365 dias	3.765.382,80	0,45	838.084.606,08	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	838.084.606,08	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

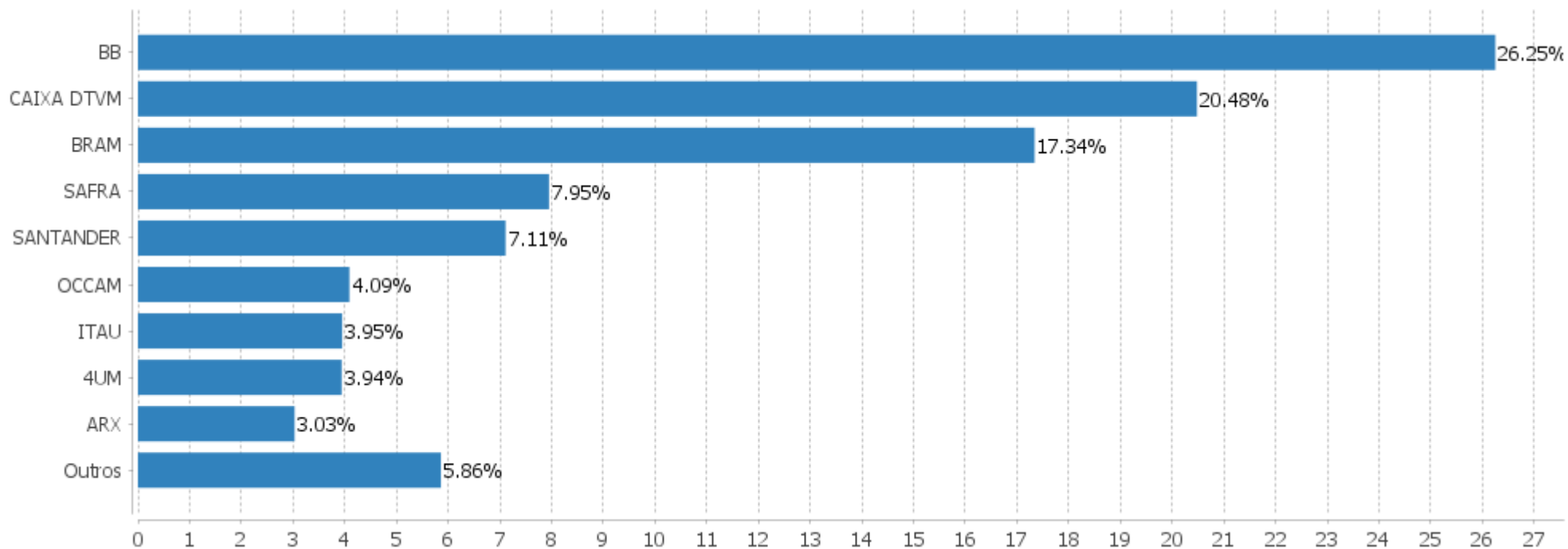


Alocação Por Estratégia



## 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	-2,23			-3,83
INPC + 5,86%	0,72	1,23	1,39	0,83	1,44	1,08	1,52	1,38	1,68	1,62			13,67
p.p. indexador	-1,67	-2,50	-0,86	0,08	-0,02	-0,74	-2,37	-2,15	-2,65	-3,85			-17,50
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

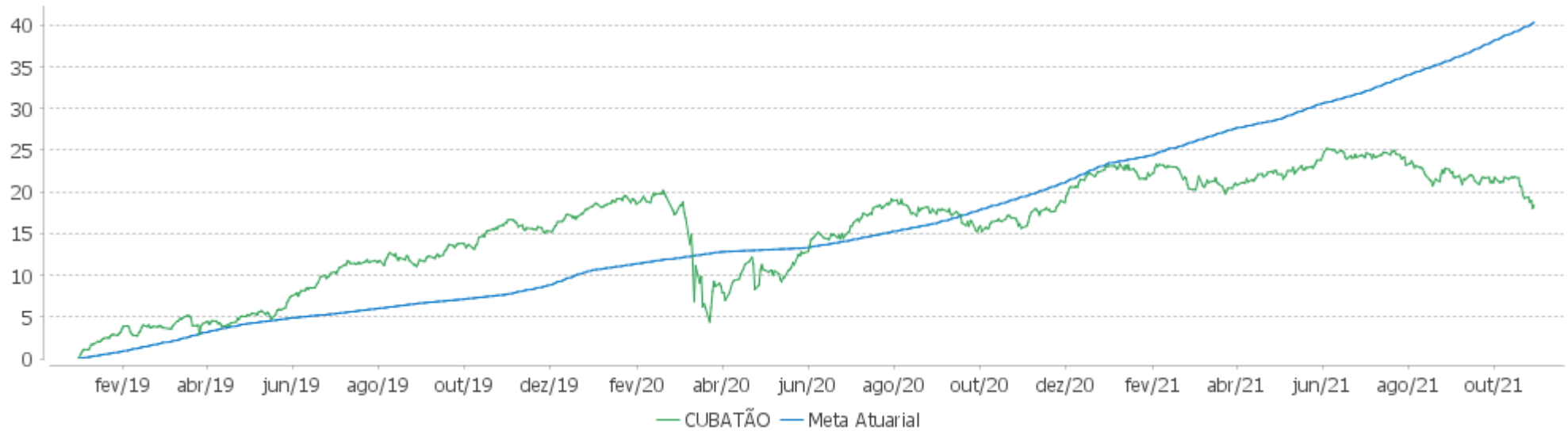
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	41,18	03 meses	-3,93	4,76	-8,68	5,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	58,82	06 meses	-3,06	9,05	-12,11	4,94
			12 meses	2,35	17,54	-15,18	4,89
			24 meses	1,80	30,33	-28,53	8,37
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	18,39	40,53	-22,14	7,37
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

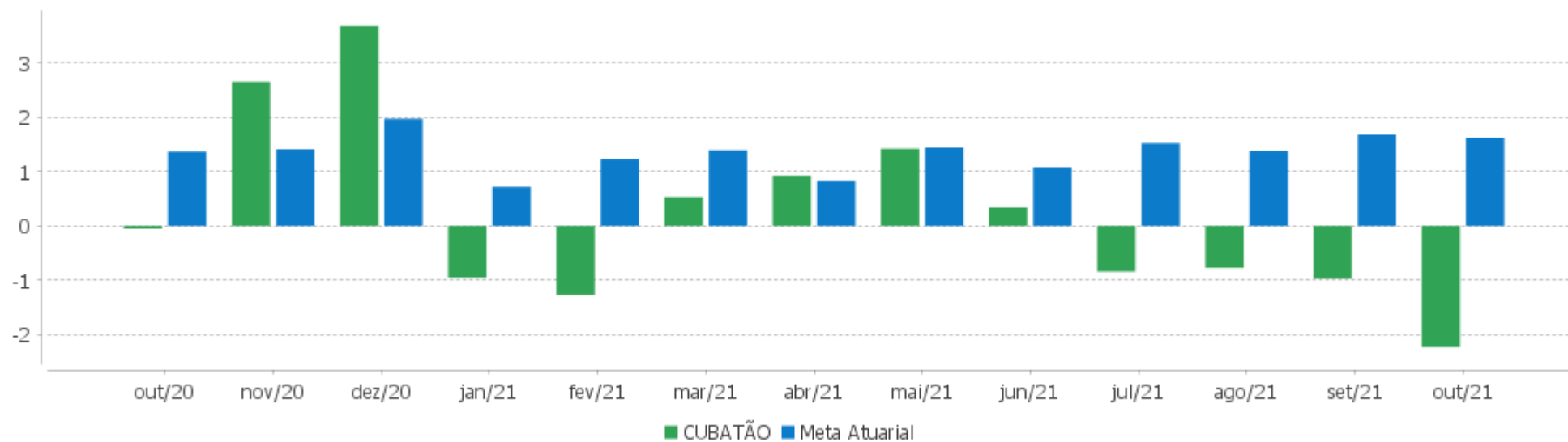


Patrimônio Líquido



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 CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	-1,48 -307,93	-0,64 -21,43	-1,40 -103,96	-1,28 -55,70	2,35 70,69	7,67 115,27	20,61 155,26
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,65 -0,11	-5,71 -0,92	-3,98 -0,24	-3,03 -0,35	0,95 -0,89	-0,37 -1,18	26,43 -1,33
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,58 120,68	3,44 114,61	1,57 116,39	2,63 114,55	3,70 111,41	6,38 95,92	12,89 97,08
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,59 -0,05	-4,97 -0,18	-3,80 -0,07	-2,78 -0,10	1,54 -0,29	0,12 -0,69	26,49 -1,27
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-1,57 -0,27	-2,63 -0,96	-2,30 -0,59	-1,65 -0,79	0,24 -0,81	3,17 -0,58	18,59 -0,52
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,60 124,18	3,51 116,92	1,58 117,48	2,68 116,72	3,96 119,13	6,40 96,19	12,94 97,45
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,55 -0,01	-4,95 -0,16	-3,78 -0,05	-2,72 -0,05	1,61 -0,22	0,21 -0,60	26,61 -1,15
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,01	-4,97 -0,18	-3,78 -0,05	-2,78 -0,11	1,58 -0,25	0,31 -0,50	26,62 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,02	-5,00 -0,22	-3,82 -0,09	-2,82 -0,14	1,58 -0,26	0,15 -0,66	26,66 -1,11
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	-0,55 -0,01	1,01 -0,23	0,19 -0,03	0,79 -0,04	1,53 -0,24	5,26 -0,65	12,48 -0,99
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,52 0,02	1,00 -0,23	0,18 -0,05	0,70 -0,12	1,52 -0,26	5,24 -0,67	12,47 -1,00
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,02	-5,05 -0,26	-3,80 -0,06	-2,85 -0,18	1,50 -0,34	0,22 -0,59	26,55 -1,21
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,25 -0,71	-8,00 -3,22	-5,38 -1,65	-4,35 -1,68	-0,84 -2,67	-1,70 -2,51	26,35 -1,41
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,58 -0,04	-4,98 -0,20	-3,83 -0,10	-2,83 -0,15	1,60 -0,23	0,29 -0,52	26,82 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,54 0,00	1,05 -0,18	0,18 -0,04	0,71 -0,12	1,55 -0,22	5,47 -0,44	12,78 -0,69
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-1,44 -0,13	-2,39 -0,71	-1,82 -0,11	-1,21 -0,35	0,36 -0,69	2,47 -1,28	17,16 -1,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	-2,58	-5,08	-3,82	-2,84	1,46	0,11	26,44



## 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.	-0,04	-0,30	-0,09	-0,17	-0,37	-0,70	-1,32
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,49 0,05	0,96 -0,27	0,19 -0,03	0,71 -0,12	1,54 -0,23	4,91 -1,00	11,96 -1,51
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	-90,81 -1.364,94	-97,89 -737,25
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,65 134,48	4,24 141,19	1,87 138,75	3,19 138,99	4,79 144,16	7,07 106,26	13,59 102,37
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	7,55 14,28	25,96 38,99	6,04 21,07	12,17 25,12	43,56 33,40	51,04 54,51	74,88 56,49
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS Var. IBOVESPA p.p.	-6,72 0,02	-23,64 -10,60	-13,39 1,64	-19,04 -6,10	-18,68 -28,84	-26,15 -22,69	-6,80 -25,19
GERAÇÃO FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-6,70 0,04	-15,94 -2,90	-15,33 -0,31	-14,24 -1,29	3,85 -6,31	-9,80 -6,33	13,31 -5,08
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,83 -0,09	-9,62 3,42	-12,52 2,51	-11,89 1,06			
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-16,09 -9,35	-19,54 -6,50	-26,86 -11,83	-22,66 -9,72	-4,60 -14,77	0,36 3,83	
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,37 1,37	-7,62 5,41	-11,37 3,65	-11,07 1,87	8,65 -1,52	7,91 11,38	54,53 36,14
ITAU INDEX IBOVESPA 1 Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-6,78 2,95	-13,47 6,63	-15,16 3,25	-13,21 3,90	9,52 18,14	-4,63 5,76	14,71 -15,23
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,96 -0,22	-17,20 -4,16	-15,67 -0,65	-16,13 -3,18	1,54 -8,63	-19,02 -15,55	15,18 -3,21
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,90 1,84	-13,38 -0,34	-13,65 1,38	-13,99 -1,05	6,72 -3,45	-0,81 2,65	27,85 9,46
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,55 3,19	-2,30 10,74	-7,30 7,72	-3,76 9,19	18,13 7,96	3,51 6,98	39,80 21,41
CUBATÃO Var. INPC + 5,86% p.p.	-2,23 -3,85	-3,83 -17,50	-3,93 -8,68	-3,06 -12,11	2,35 -15,18	1,80 -28,50	
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

## 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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

## Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

## 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	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

**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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
197	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000,00	376,57224600	2,6555330000
201	05/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	74.000,00	26.728,51009100	2,7685793090
196	05/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.260,00	0,00	1.980,50445600	2,6558890000
212	05/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.445.600,00	0,00	522.145,05660000	2,7685793090
206	05/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.950,00	0,00	16.924,65310100	2,6558890000
202	05/10/2021	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	600.000,00	0,00	2.682,06769800	223,7079998000
224	05/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	510.000,00	0,00	184.210,00198200	2,7685793090
218	05/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	191.790,00	0,00	72.213,10830300	2,6558890000
213	05/10/2021	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	308.340,00	0,00	1.601,80094000	192,4958292000
195	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	740,00	278,43021500	2,6577570000
205	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.410,00	2.411,80811400	2,6577570000
217	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.700,00	8.541,03685900	2,6577570000
200	14/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.000,00	0,00	1.081,57681000	2,7737281090
211	14/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	585.000,00	0,00	210.907,47795400	2,7737281090
223	14/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	558.000,00	0,00	201.173,28666400	2,7737281090
204	15/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.520,00	571,30485800	2,6605760000
216	15/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.400,00	2.781,35255100	2,6605760000
194	15/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	170,00	63,89592600	2,6605760000
210	19/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	69.000,00	0,00	24.920,88773800	2,7687617200
219	19/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.974,89	0,00	3.602,65382400	2,7687617200
209	20/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.000,00	0,00	1.083,18902200	2,7695997070
222	20/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	165.000,00	0,00	59.575,39625000	2,7695997070
199	20/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.900,00	0,00	4.657,71279700	2,7695997070
208	22/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	95.000,00	0,00	34.416,81759700	2,7602784520
221	22/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	20.000,00	7.245,64581000	2,7602784520
207	26/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	186.200,00	67.604,31948000	2,7542618790
220	26/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.635.130,00	1.682.893,71295500	2,7542618790
215	26/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	67.480,00	25.539,27459000	2,6422050000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
203	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.400,00	10.365,31690500	2,6434310000
214	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	98.430,00	37.235,69936900	2,6434310000
198	27/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	194.490,00	0,00	70.581,43217900	2,7555405720
193	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.130,00	1.184,06706100	2,6434310000
<b>Total</b>			<b>4.801.304,89</b>	<b>5.151.710,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 20.073.295,39

Value-At-Risk: 2,40%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CUBATÃO		2,40	2,40			838.084.606,08	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,66%

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		2,75	0,05	0,03			20.129.296,53	2,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,74	0,08	0,01			28.186.114,51	3,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,56	0,06	0,04			151.238.267,85	18,05
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		3,01	0,17	0,48			56.953.483,42	6,80
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,76	0,08	0,03			29.896.213,79	3,57
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,75	0,08	0,01			31.168.748,46	3,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,75	0,16	0,02			60.750.430,85	7,25
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,56	0,00	0,05			17.164,93	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,56	0,02	0,02			44.910.373,95	5,36
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,57	0,00	0,02			1.038.535,05	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,42	0,02	0,07			15.671.790,91	1,87
<b>Sub-total</b>	4,69	1,65	0,73		-0,46	-1,70	439.960.420,25	52,50

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		2,76	0,09	0,06			32.531.247,87	3,88
<b>Sub-total</b>	7,57	2,76	0,09		-0,40	-2,55	32.531.247,87	3,88

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		1,71	0,11	0,31			67.149.110,38	8,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		2,82	0,09	0,23			32.263.251,93	3,85
BB PREV RF IMA-B		2,76	0,11	0,04			38.824.379,58	4,63
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,04	-0,00	0,04			50.073.454,34	5,97
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP		0,05	-0,00	0,05			13.672.644,49	1,63
		2,35	0,04	2,35			17.784.314,89	2,12
<b>Sub-total</b>	4,22	1,59	0,35		-0,42	-1,29	219.767.155,61	26,22

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		0,12	0,00	0,12			9.523.862,92	1,14
<b>Sub-total</b>	0,32	0,12	0,00		0,51	0,65	9.523.862,92	1,14

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,88%

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		10,26	0,09	3,26			8.342.173,62	1,00
4UM SMALL CAPS FIA		10,66	0,13	6,60			13.596.365,58	1,62
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA		8,75	0,16	4,23			19.465.182,84	2,32
ITAU INDEX IBOVESPA 1		9,86	0,05	6,34			4.920.536,69	0,59
OCCAM FIC FIA		9,27	0,31	2,24			34.318.106,98	4,09
GERAÇÃO FI EM AÇÕES		9,43	0,18	1,52			18.925.837,85	2,26
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		9,78	0,25	1,95			25.355.067,19	3,03
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		13,82	0,05	6,94			3.765.382,80	0,45

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>	24,01	9,24	1,21		-0,27	-5,98	128.688.653,55	15,36

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		6,44	0,02	9,20			5.913.265,88	0,71
<b>Sub-total</b>	12,15	6,44	0,02		0,58	7,55	5.913.265,88	0,71

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		8,93	0,00	11,61			1.700.000,00	0,20
<b>Sub-total</b>	13,54	8,93	0,00		-0,53	-6,72	1.700.000,00	0,20