



**LDB**  
EMPRESAS

**CUBATÃO**  
JULHO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.07.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

|            |        |
|------------|--------|
| RENDA FIXA | 85,01% |
|------------|--------|

#### 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 TESOIRO IPCA GERAL FI RF               | 12,02               | 4,15            | 2,51            | 20.466.325,22  | 2,56       | 220.829.373,24    | 9,27    |
| ITAU                            | ITAU        | ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI               | 12,43               | 4,36            | 2,50            | 28.651.052,15  | 3,59       | 371.400.916,61    | 7,71    |
| BB                              | BB          | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI          | 0,54                | 0,23            | 2,69            | 106.711.506,91 | 13,37      | 7.835.713.656,67  | 1,36    |
| SAFRA                           | SAFRA       | SAFRA IMA FIC RENDA FIXA                           | 14,23               | 4,78            | 4,07            | 60.076.617,39  | 7,53       | 1.231.317.700,28  | 4,88    |
| BB                              | BB          | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI               | 12,47               | 4,36            | 2,54            | 30.396.314,41  | 3,81       | 5.823.784.558,48  | 0,52    |
| BRAM                            | BRADESCO    | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 12,48               | 4,35            | 2,43            | 31.718.155,23  | 3,97       | 783.279.334,63    | 4,05    |
| CEF                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 12,54               | 4,38            | 2,42            | 61.752.479,79  | 7,74       | 6.313.416.954,01  | 0,98    |
| SANTANDER                       | SANTANDER   | SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF       | 0,53                | 0,23            | 2,56            | 19.053.988,11  | 2,39       | 120.017.872,80    | 15,88   |
| CEF                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 0,53                | 0,24            | 2,73            | 43.793.151,11  | 5,49       | 10.907.406.871,77 | 0,40    |
| BRAM                            | BRADESCO    | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 0,53                | 0,22            | 2,66            | 1.020.090,31   | 0,13       | 946.282.128,30    | 0,11    |
| CEF                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 5,38                | 1,65            | 3,29            | 15.821.563,70  | 1,98       | 1.311.603.752,58  | 1,21    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b |             |                                                    | 7,48                | 2,58            | 2,67            | 419.461.244,33 | 52,56      |                   |         |

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

| Gestor                            | Admin. | Ativo                                             | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)   | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|---------------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------|------------------|---------|
| CEF                               | CEF    | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 12,47               | 4,40            | 2,46            | 33.065.462,63 | 4,14       | 2.998.036.270,63 | 1,10    |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a |        |                                                   | 12,47               | 4,40            | 2,46            | 33.065.462,63 | 4,14       |                  |         |

#### 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 |
|-----------|-----------|------------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------|------------------|---------|
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,31                | 0,23            | 1,17            | 47.057.082,92 | 5,90       | 1.691.934.948,09 | 2,78    |
| BRAM      | BRADESCO  | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM         | 0,23                | 0,27            | 1,42            | 13.126.894,97 | 1,64       | 3.786.771.901,20 | 0,35    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                  | Admin.   | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------------|----------|------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| CEF                                     | CEF      | FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP            | 5,01                   | 1,00               | 3,99               | 17.312.495,28         | 2,17         | 299.866.795,92   | 5,77    |
| BRAM                                    | BRABESCO | BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL   | 5,82                   | 1,86               | 3,90               | 67.698.265,87         | 8,48         | 793.683.917,20   | 8,53    |
| BRAM                                    | BRABESCO | BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 13,04                  | 4,47               | 2,70               | 33.056.038,87         | 4,14         | 1.967.216.400,50 | 1,68    |
| BB                                      | BB       | BB PREV RF IMA-B                         | 12,48                  | 4,39               | 2,36               | 39.482.078,27         | 4,95         | 1.510.787.186,06 | 2,61    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |          |                                          | <b>6,10</b>            | <b>2,17</b>        | <b>2,74</b>        | <b>217.732.856,18</b> | <b>27,28</b> |                  |         |

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

| Gestor                                   | Admin. | Ativo                           | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira  | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------------------|--------|---------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-------------|-------------|-------------|---------|
| BRPP                                     | BRPP   | FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 | 150,94                 | 0,00               | -83,89             | 0,00        | 0,00        | 0,00        |         |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b> |        |                                 | <b>150,94</b>          | <b>0,00</b>        | <b>-100,00</b>     | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> |             |         |

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

| Gestor                                   | Admin.    | Ativo                                            | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|------------------------------------------|-----------|--------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| SANTANDER                                | SANTANDER | SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO | 0,48                   | 0,41               | 0,79               | 8.121.037,26          | 1,02         | 6.359.456.703,63 | 0,13    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> |           |                                                  | <b>0,48</b>            | <b>0,41</b>        | <b>0,79</b>        | <b>8.121.037,26</b>   | <b>1,02</b>  |                  |         |
| <b>Renda Fixa</b>                        |           |                                                  | <b>7,16</b>            | <b>2,51</b>        | <b>2,66</b>        | <b>678.380.600,40</b> | <b>85,01</b> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

14,99%

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

| Gestor                                  | Admin.     | Ativo                          | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------------|------------|--------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| GERAÇÃO FUTURO                          | BRB        | GERAÇÃO FI EM AÇÕES            | 41,90                  | 9,23               | -11,31             | 19.762.519,00         | 2,48         | 353.803.988,50   | 5,59    |
| BNY MELLON                              | BNY MELLON | ARX INCOME FIA                 | 41,54                  | 8,09               | -5,18              | 25.945.647,72         | 3,25         | 762.109.603,31   | 3,40    |
| ICATU                                   | BEM        | ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | 38,76                  | 4,36               | -16,57             | 9.282.044,12          | 1,16         | 1.602.131.208,86 | 0,58    |
| 4UM                                     | BEM        | 4UM SMALL CAPS FIA             | 33,62                  | 5,58               | -8,99              | 13.885.477,86         | 1,74         | 167.408.673,12   | 8,29    |
| 4UM                                     | BEM        | 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA      | 35,87                  | 5,20               | -14,63             | 18.018.017,29         | 2,26         | 258.369.341,53   | 6,97    |
| ITAU                                    | ITAU       | ITAU INDEX IBOVESPA 1          | 44,01                  | 8,20               | -11,37             | 4.930.629,34          | 0,62         | 52.080.149,00    | 9,47    |
| OCCAM                                   | BEM        | OCCAM FIC FIA                  | 41,18                  | 9,90               | -4,71              | 25.685.662,30         | 3,22         | 782.812.250,33   | 3,28    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |            |                                | <b>38,51</b>           | <b>7,61</b>        | <b>-9,36</b>       | <b>117.509.997,63</b> | <b>14,73</b> |                  |         |

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

| Gestor                                  | Admin.      | Ativo                                          | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------------------|-------------|------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------|-------------|---------|
| BTG PACTUAL                             | BTG PACTUAL | FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS | 35,12                  | -5,35              | -20,30             | 2.127.500,00        | 0,27        | 0,00        |         |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b> |             |                                                | <b>35,12</b>           | <b>-5,35</b>       | <b>-20,30</b>      | <b>2.127.500,00</b> | <b>0,27</b> |             |         |

|                                                    |  |  |              |             |              |                       |               |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|-------------|--------------|-----------------------|---------------|--|--|
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |  | <b>38,10</b> | <b>7,35</b> | <b>-9,58</b> | <b>119.637.497,63</b> | <b>14,99</b>  |  |  |
| <b>Total</b>                                       |  |  | <b>10,58</b> | <b>3,20</b> | <b>0,56</b>  | <b>798.018.098,03</b> | <b>100,00</b> |  |  |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

| Política de Investimentos                   |                                                   |                |            |        |          |        |      |              |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|------------|--------|----------|--------|------|--------------|
| Artigo                                      | Tipo de Ativo                                     | Valor(R\$)     | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM  | Limite Legal |
| Renda Fixa                                  |                                                   |                |            |        |          |        |      |              |
| Artigo 7º I, Alínea b                       | Fundos 100% Títulos Públicos                      | 419.461.244,33 | 52,56      | 0,00   | 40,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                     | Fundos Renda Fixa Referenciados                   | 33.065.462,63  | 4,14       | 0,00   | 5,00     | 60,00  | 0,00 | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 217.732.856,18 | 27,28      | 0,00   | 23,85    | 40,00  | 0,00 | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea a                     | Cota Sênior de FIDC                               | 0,00           | 0,00       | 0,00   | 0,05     | 5,00   | 0,00 | 5,00         |
| Artigo 7º VII, Alínea b                     | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"               | 8.121.037,26   | 1,02       | 0,00   | 1,10     | 5,00   | 0,00 | 5,00         |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 678.380.600,40 | 85,01      |        |          |        |      | 100,00       |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |        |          |        |      |              |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 117.509.997,63 | 14,73      | 0,00   | 20,00    | 20,00  | 0,00 | 20,00        |
| Artigo 8º IV, Alínea b                      | Fundos de Investimentos Imobiliários              | 2.127.500,00   | 0,27       | 0,00   | 1,00     | 5,00   | 0,00 | 5,00         |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 119.637.497,63 | 14,99      |        |          |        |      | 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<br>% do CDI            | 2,58<br>1.329,16 | 2,67<br>136,56       | 4,91<br>762,64   | 2,33<br>148,46       | 6,93<br>164,46       | 10.591.208,83        | 11.284.368,93       |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | 4,40<br>2.262,18 | 2,46<br>125,96       | 8,09<br>1.256,98 | 2,22<br>141,71       | 7,80<br>185,00       | 1.392.440,25         | 793.531,21          |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 2,17<br>1.116,62 | 2,74<br>140,60       | 4,43<br>687,53   | 2,33<br>148,40       | 6,53<br>154,89       | 4.627.577,71         | 5.709.177,71        |
| Artigo 7º VII, Alínea a<br>% do CDI          | 0,00<br>0,00     | -100,00<br>-5.122,62 | 0,00<br>0,00     | -100,00<br>-6.371,09 | -100,00<br>-2.372,68 | 0,00                 | -5.276,99           |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 0,41<br>208,83   | 0,79<br>40,30        | 0,66<br>103,27   | 0,41<br>25,87        | 2,81<br>66,57        | 32.824,27            | 63.384,05           |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 7,61<br>-0,65    | -9,36<br>1,65        | 25,62<br>-2,21   | -9,18<br>0,35        | 6,32<br>5,24         | 8.311.999,29         | -12.140.023,04      |
| Artigo 8º IV, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | -5,35<br>-13,61  | -20,30<br>-9,29      | 0,32<br>-27,51   | -14,03<br>-4,49      | -8,80<br>-9,88       | -120.250,00          | -548.100,00         |
| <b>CUBATÃO (Total)</b>                       |                  |                      |                  |                      |                      | <b>24.835.800,35</b> | <b>5.157.061,87</b> |

## RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo                                              | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates      | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------------------------------|----------------|--------------|---------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI               | 29.125.718,28  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 30.396.314,41  | 1.270.596,13                | 752.338,41                  |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI          | 109.316.502,69 | 4.360.000,00 | -7.213.200,00 | 0,00        | 106.711.506,91 | 248.204,22                  | 2.598.767,35                |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 1.017.876,79   | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 1.020.090,31   | 2.213,52                    | 26.472,72                   |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 30.395.177,89  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 31.718.155,23  | 1.322.977,34                | 753.370,30                  |
| BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF               | 19.650.158,19  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 20.466.325,22  | 816.167,03                  | 500.371,45                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 15.564.425,44  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 15.821.563,70  | 257.138,26                  | 503.968,37                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 59.164.045,21  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 61.752.479,79  | 2.588.434,58                | 1.457.500,56                |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 43.687.841,02  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 43.793.151,11  | 105.310,09                  | 1.164.277,82                |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI               | 27.453.730,62  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 28.651.052,15  | 1.197.321,53                | 699.518,85                  |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA                           | 57.337.543,29  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 60.076.617,39  | 2.739.074,10                | 2.350.818,63                |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                        | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates  | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------------------------|----------------|------------|-----------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 19.005.943,67  | 7.972,41   | -3.700,00 | 0,00        | 19.053.988,11  | 43.772,03                      | 476.964,47                     |
|                                              |                |            |           |             | 419.461.244,33 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo                                             | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|---------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 31.673.022,38  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 33.065.462,63 | 1.392.440,25                   | 793.531,21                     |
|                                                   |                |            |          |             | 33.065.462,63 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo                                          | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates    | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|------------------------------------------------|----------------|------------|-------------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB PREV RF IMA-B                               | 37.823.209,12  | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 39.482.078,27  | 1.658.869,15                   | 909.568,55                     |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM         | 13.092.182,85  | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 13.126.894,97  | 34.712,12                      | 184.172,89                     |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL         | 66.459.208,18  | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 67.698.265,87  | 1.239.057,69                   | 2.538.276,97                   |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B       | 31.640.217,75  | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 33.056.038,87  | 1.415.821,12                   | 868.899,08                     |
| FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP                  | 17.141.290,92  | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 17.312.495,28  | 171.204,36                     | 663.719,36                     |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 47.114.569,65  | 0,00       | -165.400,00 | 0,00        | 47.057.082,92  | 107.913,27                     | 544.540,86                     |
|                                                |                |            |             |             | 217.732.856,18 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 7º VII, Alínea a

| Ativo                           | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|---------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|-------|--------------------------------|--------------------------------|
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 | 0,00           | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 0,00  | 0,00                           | -5.276,99                      |
|                                 |                |            |          |             | 0,00  | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 7º VII, Alínea b

| Ativo                                            | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO | 8.088.212,99   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 8.121.037,26 | 32.824,27                      | 63.384,05                      |
|                                                  |                |            |          |             | 8.121.037,26 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 8º II, Alínea a



# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                          | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA      | 17.127.487,37  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 18.018.017,29  | 890.529,92                     | -3.086.992,88                  |
| 4UM SMALL CAPS FIA             | 13.151.480,65  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 13.885.477,86  | 733.997,21                     | -1.371.139,06                  |
| ARX INCOME FIA                 | 24.003.831,67  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 25.945.647,72  | 1.941.816,05                   | -1.417.309,33                  |
| GERAÇÃO FI EM AÇÕES            | 18.092.266,85  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 19.762.519,00  | 1.670.252,15                   | -2.518.941,89                  |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | 8.894.113,96   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.282.044,12   | 387.930,16                     | -1.843.549,50                  |
| ITAU INDEX IBOVESPA 1          | 4.557.073,51   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.930.629,34   | 373.555,83                     | -632.820,97                    |
| OCCAM FIC FIA                  | 23.371.744,33  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 25.685.662,30  | 2.313.917,97                   | -1.269.269,41                  |
|                                |                |            |          |             | 117.509.997,63 | 0,00                           | 0,00                           |

Artigo 8º IV, Alínea b

| Ativo                                          | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo        | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS | 2.247.750,00   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 0,00      | 2.127.500,00 | -120.250,00                    | -548.100,00                    |
|                                                |                |            |          |             |           | 2.127.500,00 | 0,00                           | 0,00                           |

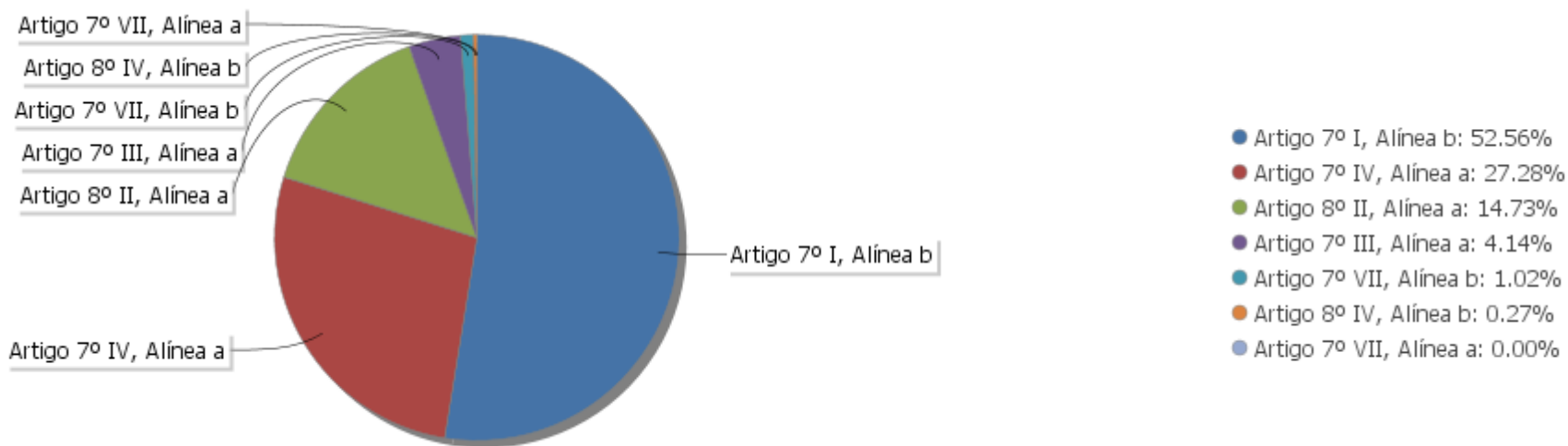
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

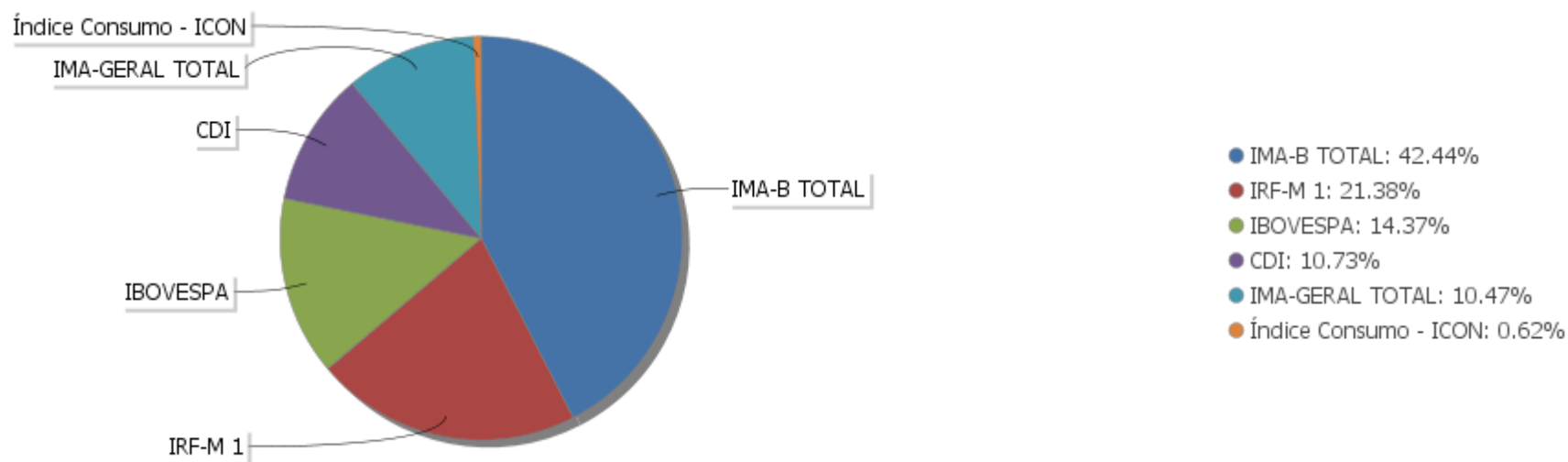
| Período           | Valor (R\$)    | (%)    | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 798.018.098,03 | 100,00 | 798.018.098,03        | 100,00    |
| de 31 a 365 dias  | 0,00           | 0,00   | 798.018.098,03        | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00           | 0,00   | 798.018.098,03        | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

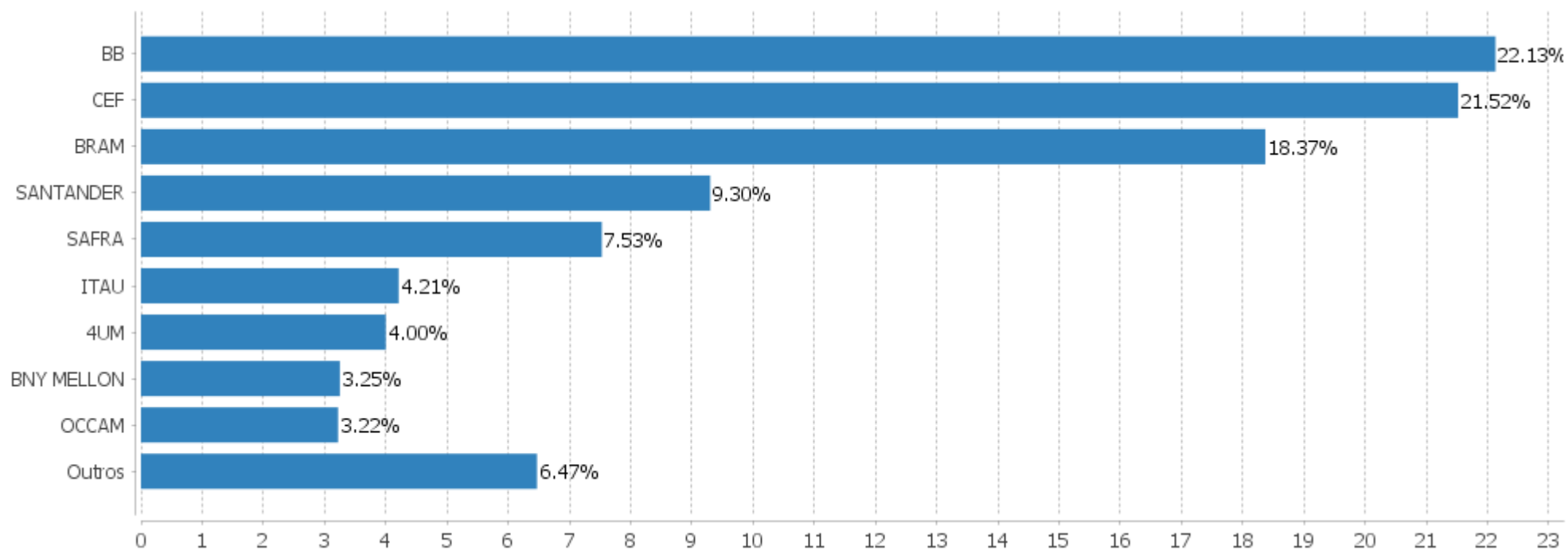


### Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano            | Jan   | Fev   | Mar   | Abr   | Mai  | Jun  | Jul  | Ago   | Set  | Out  | Nov   | Dez  | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|------|------|------|-------|------|------|-------|------|-----------|
| 2020           | 0,23  | -0,94 | -7,44 | 1,84  | 1,81 | 2,26 | 3,20 |       |      |      |       |      | 0,56      |
| INPC + 5,86%   | 0,69  | 0,58  | 0,68  | 0,22  | 0,20 | 0,78 | 0,96 |       |      |      |       |      | 4,18      |
| p.p. indexador | -0,46 | -1,52 | -8,12 | 1,61  | 1,61 | 1,48 | 2,24 |       |      |      |       |      | -3,62     |
| 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      |

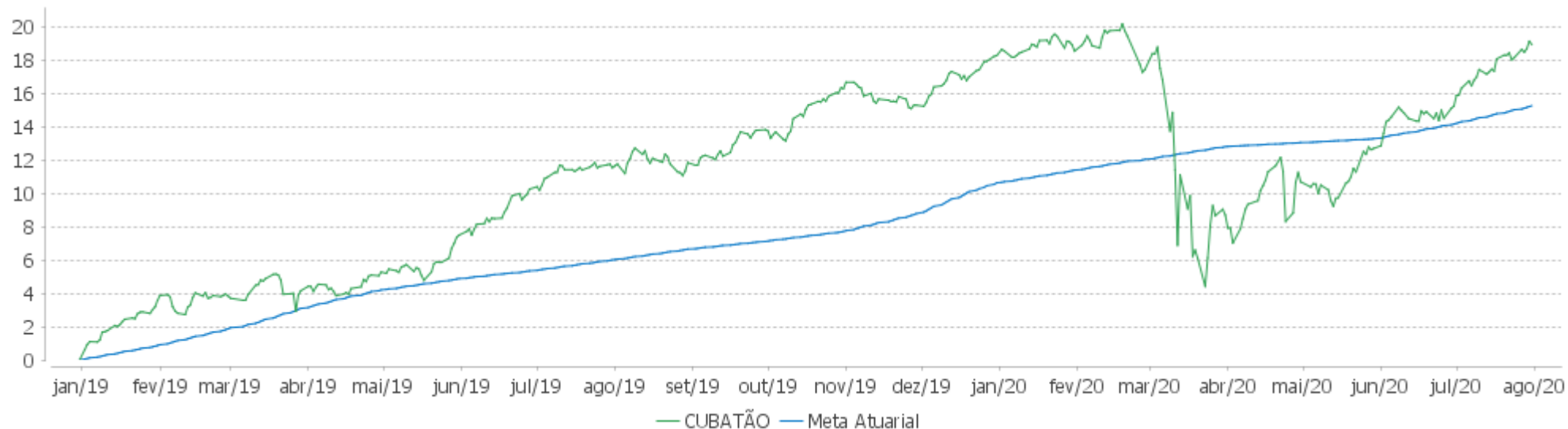
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

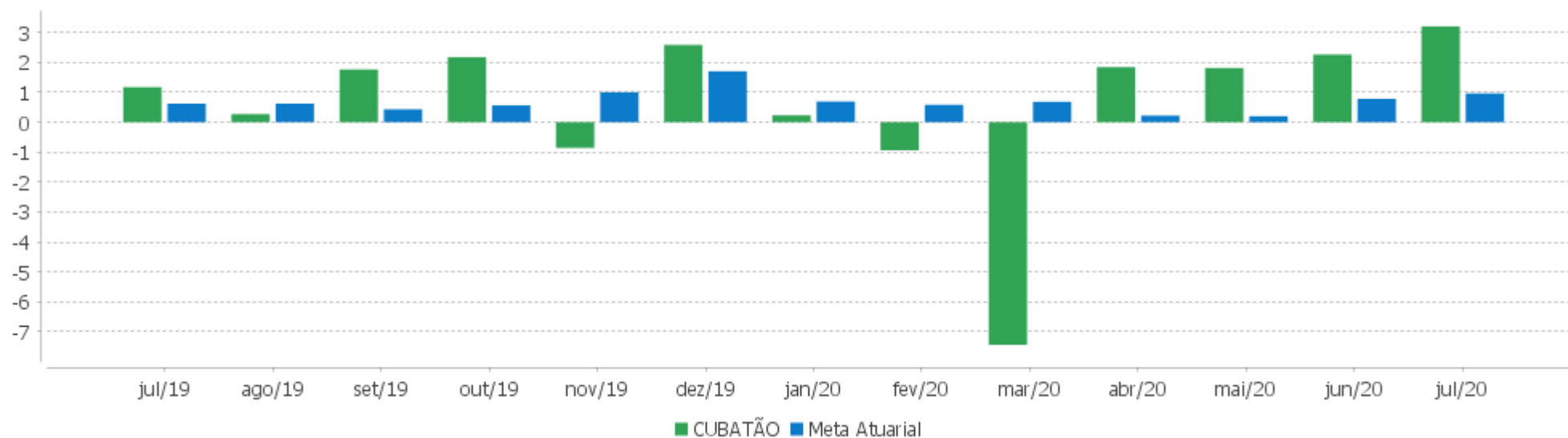
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) | Período  | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|---------------|-----------|----------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 11            | 57,89     | 03 meses | 7,45     | 1,95          | 5,50       | 5,47               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 8             | 42,11     | 06 meses | 0,33     | 3,47          | -3,14      | 14,64              |
|                                 |               |           | 12 meses | 6,63     | 8,80          | -2,17      | 10,58              |
|                                 |               |           | 24 meses |          |               |            |                    |
| Desde 31/12/2018                |               |           |          | 18,93    | 15,41         | 3,53       | 8,78               |
|                                 | Rentabilidade | Mês       |          |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,58          | 2019-01   |          |          |               |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -7,44         | 2020-03   |          |          |               |            |                    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                               | No Mês         | No Ano         | 3 meses        | 6 meses        | 12 meses       | 24 meses        | 36 meses        |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                 | 4,36<br>-0,02  | 2,50<br>-0,15  | 8,01<br>-0,13  | 2,26<br>-0,12  | 7,90<br>-0,26  | 36,89<br>-0,97  | 45,05<br>-1,70  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.         | 4,38<br>-0,01  | 2,42<br>-0,23  | 8,09<br>-0,05  | 2,17<br>-0,22  | 7,72<br>-0,43  | 37,07<br>-0,79  | 45,56<br>-1,19  |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS<br>Var. IRF-M 1 p.p.                  | 0,22<br>-0,02  | 2,66<br>-0,18  | 0,87<br>-0,07  | 2,24<br>-0,15  | 5,21<br>-0,30  | 12,59<br>-0,61  | 20,63<br>-0,93  |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.                | 0,23<br>-0,01  | 2,69<br>-0,15  | 0,88<br>-0,06  | 2,26<br>-0,13  | 5,22<br>-0,29  | 12,65<br>-0,54  | 20,70<br>-0,86  |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | 4,78<br>0,39   | 4,07<br>1,42   | 8,64<br>0,50   | 3,74<br>1,35   | 9,92<br>1,76   | 42,84<br>4,97   | 51,14<br>4,39   |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                 | 4,36<br>-0,02  | 2,54<br>-0,11  | 8,07<br>-0,07  | 2,27<br>-0,11  | 7,94<br>-0,22  | 37,20<br>-0,66  | 45,69<br>-1,07  |
| BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                 | 4,15<br>-0,23  | 2,51<br>-0,14  | 7,72<br>-0,42  | 2,25<br>-0,13  | 7,90<br>-0,25  | 36,93<br>-0,94  | 45,32<br>-1,44  |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.              | 0,24<br>0,00   | 2,73<br>-0,11  | 0,90<br>-0,04  | 2,30<br>-0,09  | 5,30<br>-0,21  | 12,79<br>-0,41  | 20,92<br>-0,64  |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 1,65<br>-0,09  | 3,29<br>-0,35  | 3,54<br>-0,25  | 2,79<br>-0,28  | 6,86<br>-0,47  | 22,77<br>-1,07  | 31,39<br>-1,72  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | 4,35<br>-0,03  | 2,43<br>-0,22  | 8,05<br>-0,09  | 2,19<br>-0,19  | 7,79<br>-0,37  | 36,89<br>-0,97  | 45,24<br>-1,51  |
| SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.             | 0,23<br>-0,01  | 2,56<br>-0,28  | 0,83<br>-0,11  | 2,14<br>-0,24  | 5,00<br>-0,50  | 12,26<br>-0,93  | 20,03<br>-1,53  |
| FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP<br>% do CDI                                     | 1,00<br>513,94 | 3,99<br>204,22 | 4,13<br>641,47 | 3,43<br>218,62 | 8,38<br>198,84 | 20,01<br>184,81 | 29,43<br>157,58 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.             | 4,47<br>0,09   | 2,70<br>0,05   | 8,39<br>0,25   | 2,42<br>0,04   | 8,21<br>0,05   | 37,96<br>0,09   | 46,44<br>-0,31  |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM<br>% do CDI                            | 0,27<br>136,43 | 1,42<br>72,89  | 0,85<br>131,37 | 1,05<br>66,84  | 3,58<br>85,04  | 10,08<br>93,08  | 18,06<br>96,70  |
| BB PREV RF IMA-B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                                     | 4,39<br>-0,00  | 2,36<br>-0,29  | 8,15<br>0,01   | 2,09<br>-0,29  | 7,74<br>-0,41  | 36,90<br>-0,96  | 45,55<br>-1,20  |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI<br>% do CDI                    | 0,27<br>136,56 | 1,17<br>59,99  | 0,52<br>81,12  | 0,79<br>50,54  | 3,27<br>77,58  | 9,82<br>90,65   | 17,59<br>94,18  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL                                        | 1,86           | 3,90           | 4,13           | 3,31           | 7,50           | 24,22           | 33,43           |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                            | No Mês          | No Ano              | 3 meses        | 6 meses             | 12 meses            | 24 meses          | 36 meses          |
|----------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------|----------------|---------------------|---------------------|-------------------|-------------------|
| Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.                                                  | 0,13            | 0,26                | 0,34           | 0,24                | 0,18                | 0,38              | 0,31              |
| SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO<br>% do CDI               | 0,41<br>208,82  | 0,79<br>40,30       | 0,66<br>103,27 | 0,41<br>25,87       | 2,81<br>66,57       | 9,30<br>85,86     | 17,12<br>91,65    |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2<br>% do CDI                                | 0,00<br>0,00    | -83,89<br>-4.297,62 | 0,00<br>0,00   | -74,30<br>-4.733,55 | -94,34<br>-2.238,32 | -98,25<br>-907,33 | -99,25<br>-531,41 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,40<br>0,01    | 2,46<br>-0,19       | 8,09<br>-0,05  | 2,22<br>-0,16       | 7,80<br>-0,36       | 36,97<br>-0,90    | 45,75<br>-1,00    |
| FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS<br>Var. IBOVESPA p.p.       | -5,35<br>-13,61 | -20,30<br>-9,29     | 0,32<br>-27,51 | -14,03<br>-4,49     | -8,80<br>-9,88      | 19,72<br>-10,18   |                   |
| GERAÇÃO FI EM AÇÕES<br>Var. IBOVESPA p.p.                                  | 9,23<br>0,97    | -11,31<br>-0,29     | 28,24<br>0,41  | -10,18<br>-0,65     | 0,46<br>-0,62       | 29,38<br>-0,53    | 34,99<br>-21,12   |
| 4UM SMALL CAPS FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                   | 5,58<br>-2,68   | -8,99<br>2,02       | 23,29<br>-4,54 | -9,61<br>-0,08      | 18,53<br>17,45      | 76,18<br>46,28    | 88,11<br>32,00    |
| ITAU INDEX IBOVESPA 1<br>Var. Índice Consumo - ICON p.p.                   | 8,20<br>0,58    | -11,37<br>-7,27     | 27,65<br>0,11  | -9,84<br>-2,35      | 0,45<br>-11,70      | 15,20<br>-39,24   | 17,38<br>-40,65   |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                       | 4,36<br>-3,90   | -16,57<br>-5,56     | 19,15<br>-8,68 | -17,09<br>-7,55     | -4,41<br>-5,49      | 43,60<br>13,69    | 57,70<br>1,58     |
| OCCAM FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                        | 9,90<br>1,64    | -4,71<br>6,30       | 29,69<br>1,85  | -5,61<br>3,93       | 7,01<br>5,93        | 46,28<br>16,37    | 82,69<br>26,58    |
| ARX INCOME FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                       | 8,09<br>-0,18   | -5,18<br>5,83       | 27,47<br>-0,36 | -4,94<br>4,60       | 13,91<br>12,83      | 49,89<br>19,98    | 90,89<br>34,77    |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                            | 5,20<br>-3,07   | -14,63<br>-3,62     | 19,68<br>-8,15 | -13,63<br>-4,09     | 1,48<br>0,40        | 25,52<br>-4,39    | 57,75<br>1,63     |
| CUBATÃO<br>Var. INPC + 5,86% p.p.                                          | 3,20<br>2,24    | 0,56<br>-3,62       | 7,45<br>5,50   | 0,33<br>-3,14       | 6,63<br>-2,11       |                   |                   |
| CDI                                                                        | 0,19            | 1,95                | 0,64           | 1,57                | 4,21                | 10,83             | 18,68             |
| IBOVESPA                                                                   | 8,27            | -11,01              | 27,83          | -9,54               | 1,08                | 29,91             | 56,12             |
| INPC + 6,00%                                                               | 0,98            | 4,26                | 1,99           | 3,54                | 8,88                | 19,01             | 30,64             |
| IPCA + 6,00%                                                               | 0,90            | 3,91                | 1,73           | 3,16                | 8,47                | 18,63             | 31,32             |

## 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              | 0,24   | 2,84   | 0,94    | 2,39    | 5,51     | 13,20    | 21,56    | 37,95    | 58,20    |
| IRF-M 1+             | 1,47   | 7,59   | 4,50    | 6,40    | 12,02    | 32,81    | 43,78    | 72,01    | 102,90   |
| IRF-M TOTAL          | 1,08   | 6,00   | 3,32    | 5,08    | 9,81     | 26,59    | 36,79    | 61,28    | 88,02    |
| IMA-B 5              | 0,99   | 4,19   | 4,28    | 3,61    | 8,83     | 24,16    | 34,43    | 52,88    | 77,77    |
| IMA-B 5+             | 7,32   | 1,68   | 11,51   | 1,64    | 7,81     | 49,37    | 56,19    | 81,01    | 123,14   |
| IMA-B TOTAL          | 4,39   | 2,65   | 8,14    | 2,38    | 8,16     | 37,86    | 46,75    | 68,72    | 103,36   |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 1,66   | 3,39   | 3,57    | 2,88    | 7,07     | 23,27    | 32,25    | 52,60    | 78,26    |
| IMA-GERAL TOTAL      | 1,74   | 3,64   | 3,79    | 3,07    | 7,33     | 23,84    | 33,11    | 53,06    | 79,37    |
| IDKA 2               | 0,94   | 4,31   | 3,72    | 3,76    | 8,68     | 22,37    | 33,35    | 52,95    | 77,27    |
| IDKA 20              | 12,08  | -1,74  | 17,28   | -0,38   | 4,95     | 69,37    | 71,28    | 102,00   | 167,98   |
| CDI                  | 0,19   | 1,95   | 0,64    | 1,57    | 4,21     | 10,83    | 18,68    | 33,52    | 52,23    |

## Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 8,27   | -11,01 | 27,83   | -9,54   | 1,08     | 29,91    | 56,12    | 79,58    | 102,33   |
| IBRX 100                 | 8,41   | -10,43 | 28,20   | -9,30   | 2,17     | 33,69    | 59,04    | 83,45    | 104,97   |
| IBRX 50                  | 8,15   | -11,06 | 29,00   | -9,35   | 0,23     | 26,69    | 52,24    | 74,72    | 93,17    |
| SMALL CAP                | 9,50   | -13,20 | 31,66   | -13,59  | 7,86     | 55,28    | 71,97    | 116,70   | 152,93   |
| IFIX                     | -2,61  | -14,53 | 4,97    | -11,18  | 2,77     | 26,86    | 32,28    | 57,44    | 85,83    |
| Índice Consumo - ICON    | 7,62   | -4,11  | 27,54   | -7,49   | 12,15    | 54,44    | 58,02    | 66,72    | 79,11    |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,53   | -13,05 | 21,87   | -11,65  | 3,50     | 46,49    | 63,19    | 107,43   | 132,43   |

## 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      | 0,36   | 0,46   | 0,24    | 0,25    | 2,31     | 5,60     | 10,34    | 13,33    | 23,23    |
| INPC      | 0,44   | 0,80   | 0,49    | 0,61    | 2,69     | 5,94     | 9,76     | 12,04    | 22,75    |
| IGPM      | 2,23   | 6,71   | 4,11    | 6,21    | 9,27     | 16,26    | 25,84    | 23,74    | 38,14    |
| SELIC     | 0,19   | 1,95   | 0,64    | 1,57    | 4,21     | 10,83    | 18,69    | 33,55    | 52,29    |

### 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    | 0,26   | 30,70  | 7,69    | 23,59   | 51,69    | 60,95    | 120,08   | 141,76   | 138,37   |
| MSCI ACWI  | -0,09  | 26,04  | 8,17    | 20,40   | 45,47    | 47,12    | 92,06    | 113,08   | 98,25    |
| MSCI World | -0,53  | 26,16  | 7,65    | 19,92   | 45,62    | 48,35    | 95,35    | 115,06   | 100,14   |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,72   | 2,77   | 1,24    | 2,20    | 6,41     | 14,20    | 24,06    | 32,50    | 49,79    |
| IPCA + 5,00% | 0,81   | 3,34   | 1,49    | 2,68    | 7,44     | 16,40    | 27,66    | 37,65    | 57,09    |
| IPCA + 5,50% | 0,85   | 3,62   | 1,61    | 2,92    | 7,96     | 17,51    | 29,48    | 40,28    | 60,85    |
| IPCA + 5,89% | 0,89   | 3,85   | 1,71    | 3,11    | 8,36     | 18,38    | 30,92    | 42,35    | 63,83    |
| IPCA + 6,00% | 0,90   | 3,91   | 1,73    | 3,16    | 8,47     | 18,63    | 31,32    | 42,94    | 64,68    |
| INPC + 4,00% | 0,80   | 3,12   | 1,50    | 2,57    | 6,82     | 14,57    | 23,41    | 31,00    | 49,21    |
| INPC + 6,00% | 0,98   | 4,26   | 1,99    | 3,54    | 8,88     | 19,01    | 30,64    | 41,32    | 64,05    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

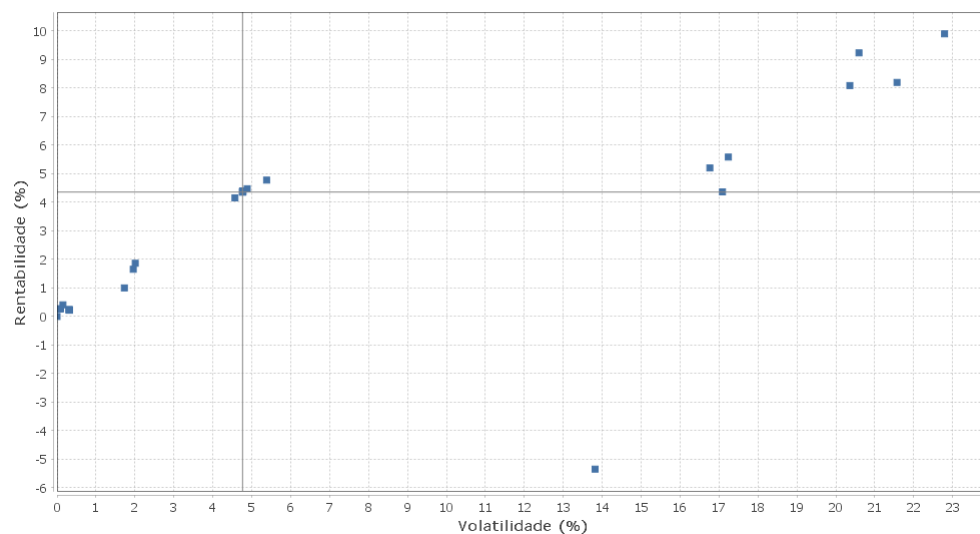
Movimentações

| APR          | Data       | Ativo                                          | Aplicação    | Resgate      | Quantidade         | Valor Cota     |
|--------------|------------|------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------------|----------------|
| 155          | 03/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 1.200.000,00 | 0,00         | 444.623,98443200   | 2,6989097350   |
| 105          | 03/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 203.000,00   | 0,00         | 75.215,55736600    | 2,6989097350   |
| 107          | 03/07/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 16.000,00    | 86,59355647        | 184,7712538000 |
| 109          | 03/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 1.772.000,00 | 0,00         | 656.561,41701200   | 2,6989097350   |
| 156          | 07/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 0,00         | 2.335.000,00 | 865.329,02954000   | 2,6983955470   |
| 103          | 07/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 0,00         | 77.500,00    | 28.720,77078800    | 2,6983955470   |
| 157          | 14/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 0,00         | 4.464.200,00 | 1.653.741,64635600 | 2,6994543010   |
| 104          | 14/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 0,00         | 336.500,00   | 124.654,82370800   | 2,6994543010   |
| 113          | 14/07/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 13.500,00    | 73,00932199        | 184,9078944000 |
| 110          | 15/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 486.000,00   | 0,00         | 180.035,02801500   | 2,6994746820   |
| 106          | 21/07/2020 | SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF   | 7.972,41     | 0,00         | 310,93355581       | 25,6402368000  |
| 158          | 22/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 180.000,00   | 0,00         | 66.644,60091000    | 2,7008939590   |
| 111          | 22/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 349.000,00   | 0,00         | 129.216,47621000   | 2,7008939590   |
| 98           | 30/07/2020 | SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF   | 0,00         | 3.700,00     | 144,08150802       | 25,6799089000  |
| 108          | 30/07/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 113.300,00   | 611,90503942       | 185,1594491000 |
| 114          | 30/07/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00         | 22.600,00    | 122,05696285       | 185,1594491000 |
| 159          | 31/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 155.200,00   | 0,00         | 57.382,55745900    | 2,7046546350   |
| 99           | 31/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 9.200,00     | 0,00         | 3.401,54335400     | 2,7046546350   |
| 112          | 31/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 5.600,00     | 0,00         | 2.070,50465000     | 2,7046546350   |
| <b>Total</b> |            |                                                |              |              |                    |                |

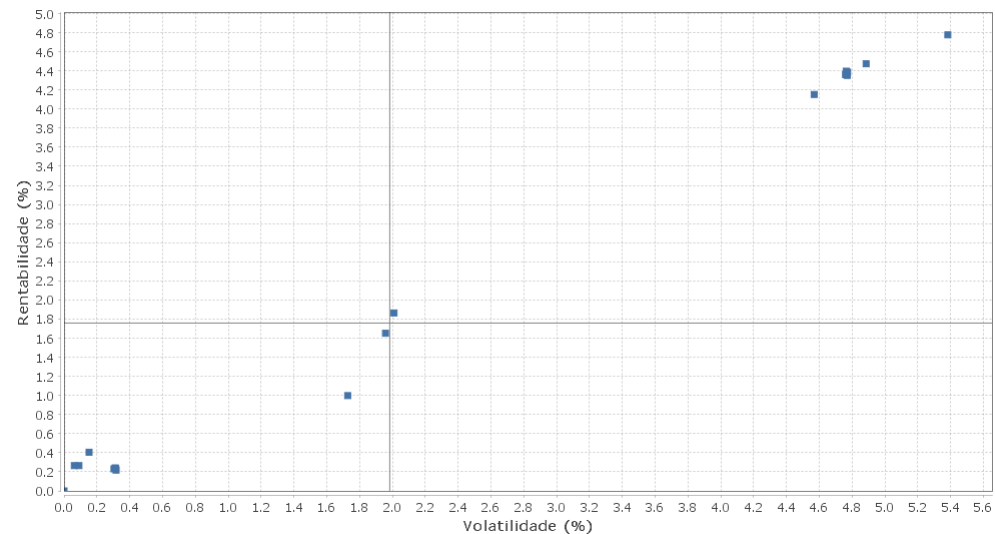
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão

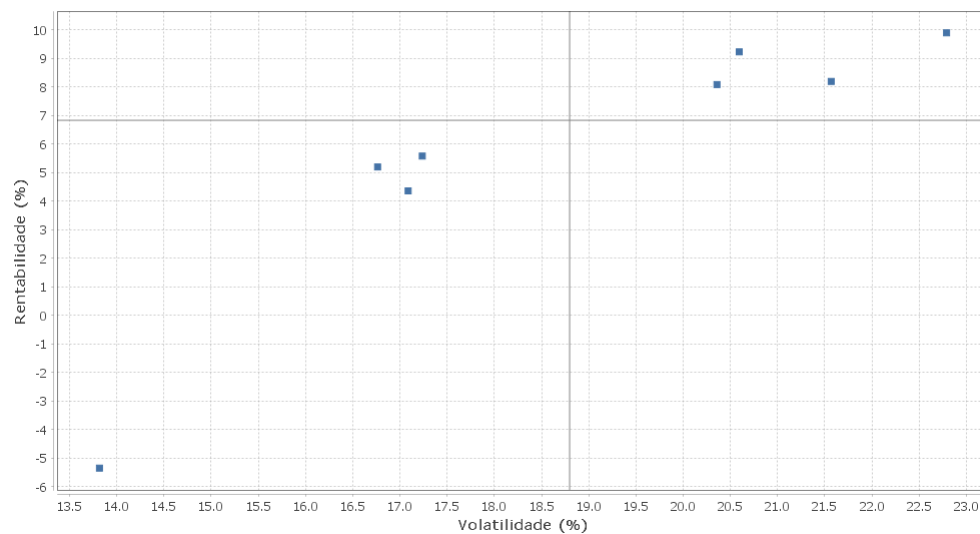
CUBATÃO - No Mês



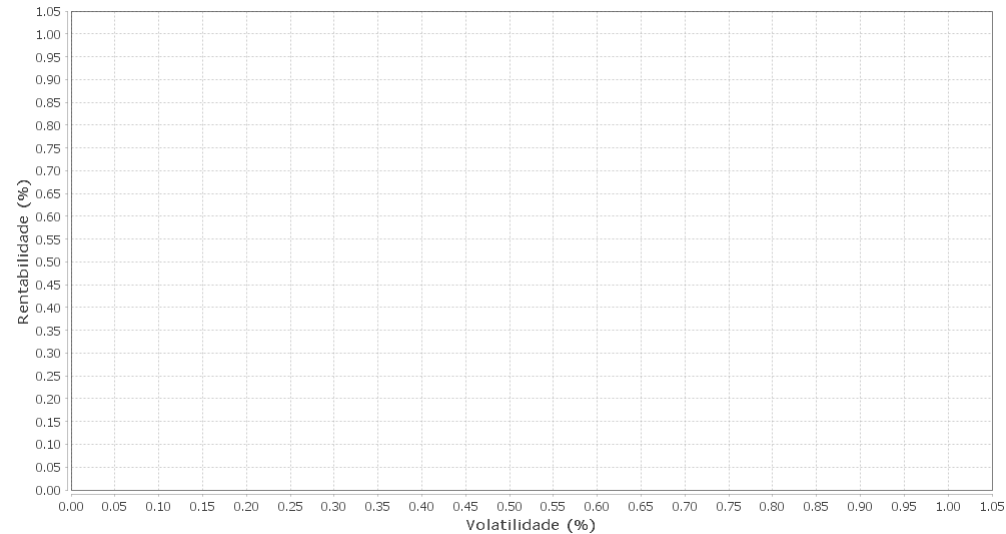
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 50.486.752,88

Value-At-Risk: 6,33%

| Ativo                                              | Estratégia              | Volatilidade | VaR   | CVaR  | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|----------------------------------------------------|-------------------------|--------------|-------|-------|--------|-------|----------------|------------|
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2                    | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,00         | NaN   | 0,00  | 0,00   | 0,00  | 0,00           | 0,00       |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM             | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,06         | 0,17  | -0,00 | 1,13   | 0,27  | 13.126.894,97  | 1,64       |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI     | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,09         | 0,23  | -0,00 | 0,79   | 0,27  | 47.057.082,92  | 5,90       |
| SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO   | Artigo 7º VII, Alínea b | 0,15         | 0,39  | 0,00  | 1,39   | 0,41  | 8.121.037,26   | 1,02       |
| SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF       | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,30         | 0,34  | 0,00  | 0,12   | 0,23  | 19.053.988,11  | 2,39       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,31         | 0,34  | 0,01  | 0,15   | 0,24  | 43.793.151,11  | 5,49       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI          | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,31         | 0,34  | 0,03  | 0,12   | 0,23  | 106.711.506,91 | 13,37      |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,32         | 0,34  | 0,00  | 0,07   | 0,22  | 1.020.090,31   | 0,13       |
| FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP                      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 1,73         | 2,29  | 0,04  | 0,47   | 1,00  | 17.312.495,28  | 2,17       |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,96         | 2,68  | 0,05  | 0,74   | 1,65  | 15.821.563,70  | 1,98       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL             | Artigo 7º IV, Alínea a  | 2,01         | 2,93  | 0,23  | 0,83   | 1,86  | 67.698.265,87  | 8,48       |
| BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF               | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,57         | 5,64  | 0,14  | 0,87   | 4,15  | 20.466.325,22  | 2,56       |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI               | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,76         | 5,90  | 0,20  | 0,88   | 4,36  | 28.651.052,15  | 3,59       |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI               | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,76         | 5,98  | 0,21  | 0,87   | 4,36  | 30.396.314,41  | 3,81       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP  | Artigo 7º III, Alínea a | 4,76         | 5,89  | 0,23  | 0,88   | 4,40  | 33.065.462,63  | 4,14       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,77         | 5,91  | 0,22  | 0,87   | 4,35  | 31.718.155,23  | 3,97       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,77         | 5,93  | 0,43  | 0,88   | 4,38  | 61.752.479,79  | 7,74       |
| BB PREV RF IMA-B                                   | Artigo 7º IV, Alínea a  | 4,77         | 5,91  | 0,27  | 0,88   | 4,39  | 39.482.078,27  | 4,95       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B           | Artigo 7º IV, Alínea a  | 4,89         | 6,10  | 0,24  | 0,88   | 4,47  | 33.056.038,87  | 4,14       |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA                           | Artigo 7º I, Alínea b   | 5,38         | 6,80  | 0,48  | 0,85   | 4,78  | 60.076.617,39  | 7,53       |
| FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS     | Artigo 8º IV, Alínea b  | 13,82        | 13,57 | 0,03  | -0,40  | -5,35 | 2.127.500,00   | 0,27       |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA                          | Artigo 8º II, Alínea a  | 16,76        | 23,85 | 0,51  | 0,30   | 5,20  | 18.018.017,29  | 2,26       |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                     | Artigo 8º II, Alínea a  | 17,09        | 28,04 | 0,31  | 0,24   | 4,36  | 9.282.044,12   | 1,16       |
| 4UM SMALL CAPS FIA                                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 17,24        | 25,28 | 0,37  | 0,31   | 5,58  | 13.885.477,86  | 1,74       |
| ARX INCOME FIA                                     | Artigo 8º II, Alínea a  | 20,36        | 26,88 | 0,83  | 0,39   | 8,09  | 25.945.647,72  | 3,25       |
| GERAÇÃO FI EM AÇÕES                                | Artigo 8º II, Alínea a  | 20,59        | 25,66 | 0,60  | 0,44   | 9,23  | 19.762.519,00  | 2,48       |
| ITAU INDEX IBOVESPA 1                              | Artigo 8º II, Alínea a  | 21,57        | 26,52 | 0,16  | 0,37   | 8,20  | 4.930.629,34   | 0,62       |
| OCCAM FIC FIA                                      | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,79        | 24,58 | 0,74  | 0,43   | 9,90  | 25.685.662,30  | 3,22       |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

-Referente ao mês de julho de 2020, vale observar que:

- O Fundo de Previdência está com 15,08% do patrimônio líquido do fundo SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA (Art. 7, Inciso I, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;