



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
MAIO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2021.

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

70,01%

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 |
|--|-----------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|-------------------|---------|
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M | 2,98 | 0,16 | -1,87 | 1.875.126,97 | 0,98 | 7.136.312.109,36 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 5,83 | 1,05 | -1,19 | 15.760.670,39 | 8,24 | 7.382.686.390,39 | 0,21 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,82 | 1,04 | -1,23 | 13.209.615,69 | 6,91 | 5.804.299.790,87 | 0,23 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,44 | 0,67 | 1,31 | 8.235.084,23 | 4,31 | 14.343.181.790,80 | 0,06 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 2,43 | 0,68 | 1,34 | 12.577.522,05 | 6,58 | 1.251.943.442,66 | 1,00 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR | 5,82 | 1,03 | -1,26 | 19.604.573,85 | 10,25 | 1.180.044.595,00 | 1,66 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 9,15 | 1,39 | -3,40 | 10.259.648,88 | 5,37 | 1.528.376.681,14 | 0,67 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2,44 | 0,69 | 1,36 | 12.043.981,76 | 6,30 | 5.747.060.006,20 | 0,21 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 4,79 | 0,93 | -0,60 | 93.566.223,82 | 48,94 | | |

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 FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,17 | 0,30 | 1,09 | 2.906.801,22 | 1,52 | 3.189.338.399,07 | 0,09 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,26 | 0,24 | 0,85 | 10.155.169,74 | 5,31 | 5.770.121.590,43 | 0,18 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 6,11 | 0,99 | -1,80 | 8.156.944,84 | 4,27 | 1.859.083.226,91 | 0,44 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,17 | 0,28 | 0,99 | 1.182.778,84 | 0,62 | 3.866.862.013,76 | 0,03 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | 9,07 | 1,41 | -3,18 | 4.579.806,85 | 2,40 | 205.930.010,19 | 2,22 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,03 | 0,20 | 0,62 | 99.146,78 | 0,05 | 567.210.701,26 | 0,02 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 2,62 | 0,60 | 0,82 | 12.880.246,68 | 6,74 | 1.166.601.720,84 | 1,10 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF ATIVO FIC | 0,69 | 0,33 | 0,51 | 314.972,35 | 0,16 | 969.985.350,52 | 0,03 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 2,76 | 0,64 | -0,06 | 40.275.867,30 | 21,07 | | |
| Renda Fixa | | | 4,13 | 0,84 | -0,43 | 133.842.091,12 | 70,01 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,99%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|---------|---------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRAM | BRDESCO | BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS | 22,13 | 6,12 | 5,91 | 12.278.507,90 | 6,42 | 357.445.092,59 | 3,44 |
| CEF | CEF | FIA BRASIL IBX-50 | 22,48 | 6,33 | 9,06 | 11.950.086,14 | 6,25 | 1.223.467.892,96 | 0,98 |
| BB | BB | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 21,58 | 5,51 | 8,26 | 3.120.542,30 | 1,63 | 1.330.479.590,28 | 0,23 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 22,17 | 6,14 | 7,53 | 27.349.136,34 | 14,30 | | |

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 |
|---|-----------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | 21,61 | 6,08 | 1,56 | 1.239.786,90 | 0,65 | 389.089.997,43 | 0,32 |
| BRAM | BEM | BRDESCO F I A SELECTION | 21,88 | 5,99 | 3,57 | 4.729.453,02 | 2,47 | 773.978.436,40 | 0,61 |
| BB | BB | BB AÇÕES DIVIDENDOS | 19,97 | 6,30 | 5,19 | 4.141.909,61 | 2,17 | 1.073.363.044,49 | 0,39 |
| BRAM | BEM | BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 20,88 | 8,31 | 12,54 | 7.110.905,34 | 3,72 | 2.367.208.838,54 | 0,30 |
| ITAU | ITAU | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 20,64 | 5,11 | 5,45 | 3.878.104,84 | 2,03 | 1.064.104.213,35 | 0,36 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 23,52 | 6,62 | 10,25 | 4.084.512,99 | 2,14 | 1.225.325.293,15 | 0,33 |
| BB | BB | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 20,59 | 4,39 | 5,86 | 4.810.357,08 | 2,52 | 510.786.954,02 | 0,94 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 20,27 | 6,29 | 7,24 | 29.995.029,78 | 15,69 | | |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

20,95 6,22 7,38 57.344.166,12 29,99

Total

7,58 2,39 1,81 191.186.257,24 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | | |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 93.566.223,82 | 48,94 | 20,00 | 30,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 40.275.867,30 | 21,07 | 0,00 | 30,00 | 40,00 | 0,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 133.842.091,12 | 70,01 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 27.349.136,34 | 14,30 | 0,00 | 20,00 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 29.995.029,78 | 15,69 | 0,00 | 10,00 | 20,00 | 0,00 | 20,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 57.344.166,12 | 29,99 | | | | | 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 % do CDI | 0,93 345,43 | -0,60 -62,03 | 1,35 198,04 | 3,39 299,40 | 8,28 379,78 | 865.601,05 | -556.344,27 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,64 236,35 | -0,06 -6,46 | 1,04 152,88 | 2,36 208,25 | 5,45 250,29 | 261.188,39 | -52.437,26 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 6,14 -0,02 | 7,53 1,49 | 15,45 0,74 | 17,36 1,45 | 46,18 1,77 | 1.582.705,18 | 1.915.981,69 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 6,29 0,13 | 7,24 1,19 | 13,88 -0,82 | 16,03 0,13 | 42,12 -2,29 | 1.773.844,79 | 2.025.145,35 |
| ILHA SOLTEIRA (Total) | | | | | | 4.483.339,41 | 3.332.345,51 |

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 5 LP FIC FI | 11.962.020,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.043.981,76 | 81.961,76 | 161.220,88 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 15.596.171,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.760.670,39 | 164.498,65 | -189.693,64 |
| BB PREV RF IRF-M | 1.872.151,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.875.126,97 | 2.975,30 | -25.124,24 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 10.118.871,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.259.648,88 | 140.777,52 | -361.201,85 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 8.180.326,43 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.235.084,23 | 54.757,80 | 106.172,23 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 13.073.310,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.209.615,69 | 136.304,95 | -164.722,35 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 12.492.767,32 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.577.522,05 | 84.754,73 | 166.778,33 |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR | 19.405.003,51 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 19.604.573,85 | 199.570,34 | -249.773,63 |
| | | | | | 93.566.223,82 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|--------------|-------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.508.581,96 | 0,00 | -330.000,00 | 0,00 | 1.182.778,84 | 4.196,88 | 18.454,06 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 2.298.026,04 | 1.100.000,00 | -500.000,00 | 0,00 | 2.906.801,22 | 8.775,18 | 31.954,58 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 12.802.894,61 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.880.246,68 | 77.352,07 | 104.830,97 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|-------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 8.076.885,79 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.156.944,84 | 80.059,05 | -149.497,73 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | 4.516.297,04 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.579.806,85 | 63.509,81 | -150.406,05 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 98.951,55 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 99.146,78 | 195,23 | 609,10 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 10.425.135,11 | 0,00 | -295.000,00 | 0,00 | 10.155.169,74 | 25.034,63 | 88.898,54 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC | 732.906,81 | 0,00 | -420.000,00 | 0,00 | 314.972,35 | 2.065,54 | 2.688,95 |
| | | | | | 40.275.867,30 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º I, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 2.957.471,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.120.542,30 | 163.070,39 | 238.095,94 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | 11.570.441,76 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.278.507,90 | 708.066,14 | 685.265,99 |
| FIA BRASIL IBX-50 | 11.238.517,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.950.086,14 | 711.568,65 | 992.619,76 |
| | | | | | 27.349.136,34 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º II, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 4.608.124,30 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.810.357,08 | 202.232,78 | 266.331,95 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | 3.896.262,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.141.909,61 | 245.647,52 | 204.375,45 |
| BRADESCO F I A SELECTION | 4.462.078,70 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.729.453,02 | 267.374,32 | 162.880,77 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 6.565.577,16 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.110.905,34 | 545.328,18 | 792.284,62 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 3.830.773,17 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.084.512,99 | 253.739,82 | 379.854,45 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 3.689.590,22 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.878.104,84 | 188.514,62 | 200.336,38 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | 1.168.779,35 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.239.786,90 | 71.007,55 | 19.081,73 |
| | | | | | 29.995.029,78 | 0,00 | 0,00 |

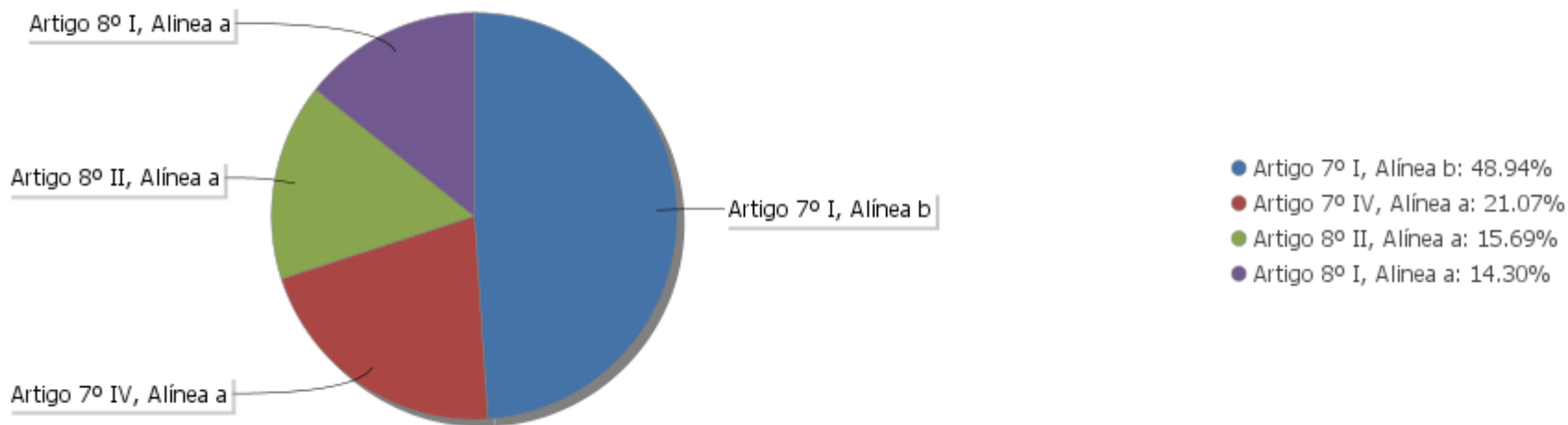
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

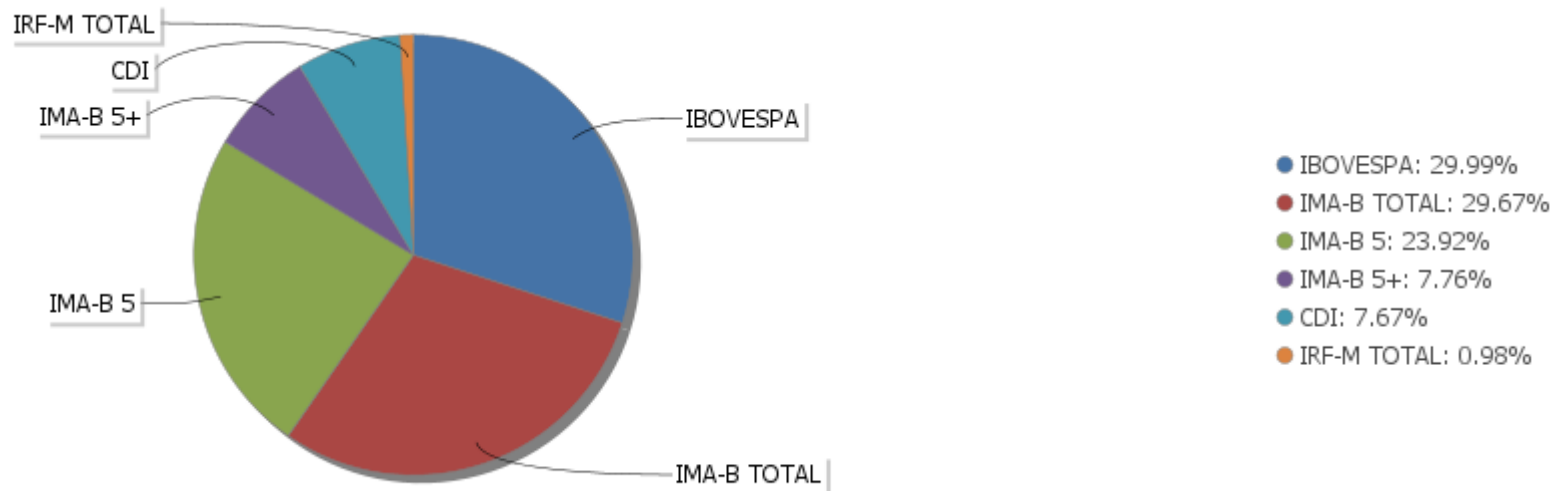
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 191.186.257,24 | 100,00 | 191.186.257,24 | 100,00 |
| de 31 a 365 dias | 0,00 | 0,00 | 191.186.257,24 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 191.186.257,24 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

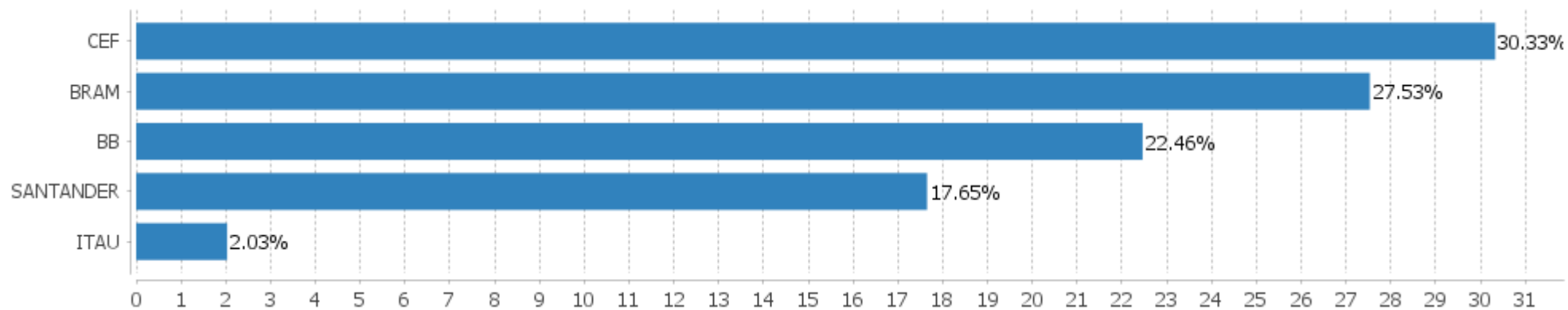


Alocação Por Estratégia



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 | -1,25 | -1,72 | 1,08 | 1,36 | 2,39 | | | | | | | | 1,81 |
| IPCA + 5,42% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,27 | | | | | | | | 5,45 |
| p.p. indexador | -1,92 | -2,97 | -0,34 | 0,63 | 1,12 | | | | | | | | -3,64 |
| 2020 | 0,07 | -2,11 | -11,70 | 2,89 | 2,80 | 3,28 | 4,26 | -1,48 | -1,92 | -0,10 | 4,59 | 4,91 | 4,37 |
| IPCA + 5,89% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,89 | 0,72 | 1,12 | 1,34 | 1,35 | 1,86 | 10,65 |
| p.p. indexador | -0,64 | -2,77 | -12,27 | 2,74 | 2,73 | 2,54 | 3,38 | -2,19 | -3,04 | -1,44 | 3,24 | 3,06 | -6,28 |
| 2019 | 4,73 | -0,18 | 0,32 | 1,16 | 1,98 | 3,00 | 1,22 | -0,06 | 2,34 | 2,42 | -0,78 | 3,49 | 21,34 |
| IPCA + 6,00% | 0,83 | 0,90 | 1,19 | 1,06 | 0,64 | 0,45 | 0,72 | 0,62 | 0,45 | 0,63 | 0,98 | 1,64 | 10,59 |
| p.p. indexador | 3,90 | -1,08 | -0,87 | 0,10 | 1,34 | 2,55 | 0,50 | -0,68 | 1,90 | 1,79 | -1,75 | 1,85 | 10,75 |
| 2018 | 3,56 | 0,54 | 0,75 | 0,28 | -3,68 | -1,22 | 3,16 | -0,91 | 0,92 | 5,90 | 1,11 | 0,71 | 11,33 |
| IPCA + 6,00% | 0,80 | 0,74 | 0,58 | 0,71 | 0,89 | 1,75 | 0,84 | 0,44 | 0,92 | 0,96 | 0,25 | 0,61 | 9,92 |
| p.p. indexador | 2,75 | -0,20 | 0,17 | -0,43 | -4,57 | -2,97 | 2,32 | -1,35 | -0,00 | 4,93 | 0,85 | 0,09 | 1,41 |
| 2017 | 1,97 | 1,97 | 0,71 | 0,39 | -0,92 | 0,38 | 2,98 | 1,87 | 1,82 | 0,02 | -0,78 | 1,65 | 12,66 |
| IPCA + 6,00% | 0,89 | 0,75 | 0,78 | 0,56 | 0,82 | 0,26 | 0,73 | 0,72 | 0,62 | 0,91 | 0,74 | 0,91 | 9,05 |
| p.p. indexador | 1,07 | 1,22 | -0,08 | -0,17 | -1,75 | 0,13 | 2,26 | 1,15 | 1,20 | -0,89 | -1,53 | 0,75 | 3,61 |

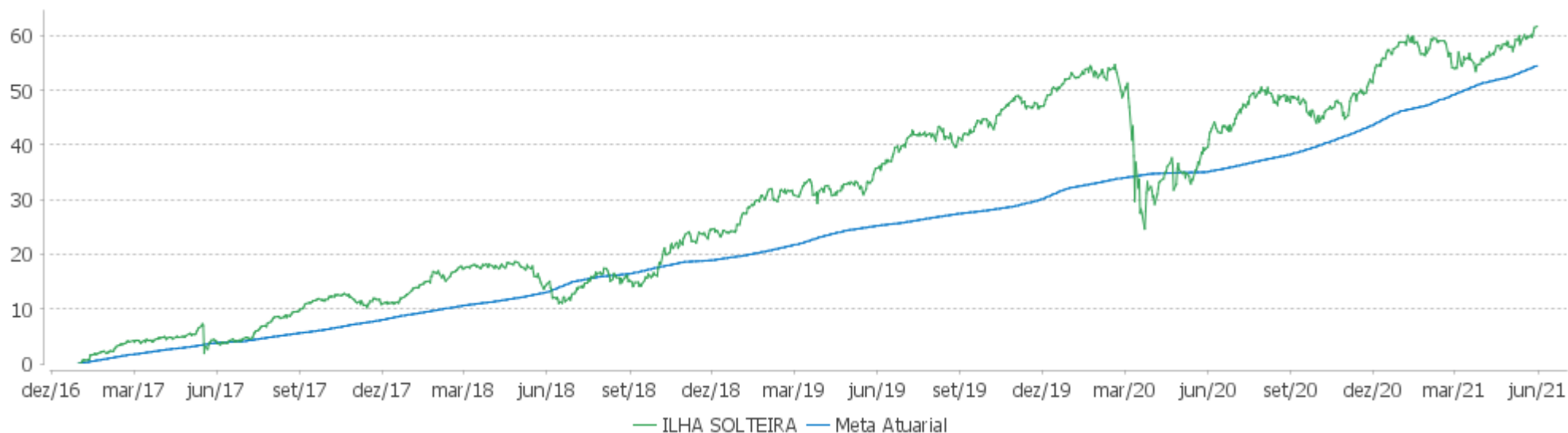
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

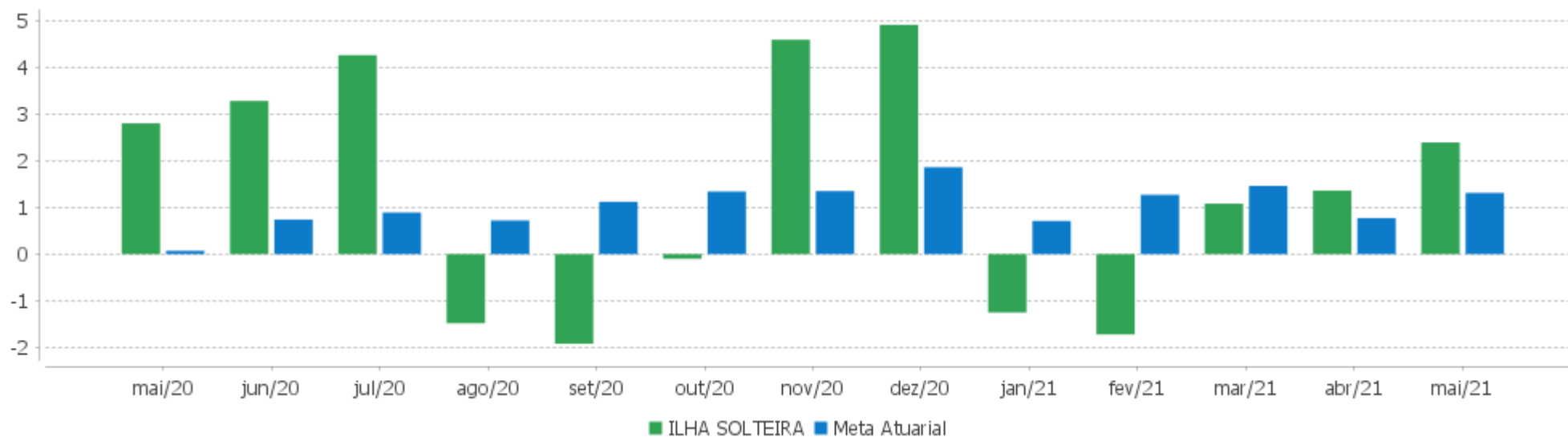
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 29 | 54,72 | 03 meses | 4,91 | 3,46 | 1,44 | 7,01 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 24 | 45,28 | 06 meses | 6,81 | 7,41 | -0,60 | 7,19 |
| | | | 12 meses | 16,13 | 14,19 | 1,94 | 7,58 |
| | | | 24 meses | 19,15 | 23,23 | -4,08 | 12,11 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,90 | 2018-10 | 36 meses | 41,66 | 36,68 | 4,98 | 10,80 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -11,70 | 2020-03 | 48 meses | 55,26 | 48,91 | 6,34 | 9,60 |
| | | | Desde 30/12/2016 | 61,69 | 54,66 | 7,03 | 9,52 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,04 -0,02 | -1,23 -0,09 | 1,20 -0,05 | 3,55 -0,11 | 8,92 -0,25 | 15,71 -0,75 | 42,92 -1,18 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,68 -0,01 | 1,34 -0,07 | 1,86 -0,05 | 3,18 -0,10 | 7,13 -0,26 | 17,09 -0,46 | 32,30 -0,79 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,67 -0,02 | 1,31 -0,11 | 1,85 -0,07 | 3,15 -0,12 | 7,10 -0,30 | 16,90 -0,65 | 32,13 -0,96 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,69 -0,00 | 1,36 -0,06 | 1,89 -0,03 | 3,19 -0,09 | 7,12 -0,28 | 17,04 -0,51 | 32,23 -0,86 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,05 -0,00 | -1,19 -0,05 | 1,22 -0,02 | 3,59 -0,07 | 8,90 -0,27 | 15,96 -0,50 | 43,05 -1,05 |
| BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p. | 0,16 -0,04 | -1,87 -0,08 | 0,11 -0,08 | 0,06 -0,08 | 0,51 -0,21 | 11,56 -0,54 | 26,18 -0,87 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | 1,39 0,01 | -3,40 -0,05 | 0,63 -0,02 | 3,90 -0,00 | 10,54 -0,15 | 14,65 -0,65 | 51,10 -1,74 |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,03 -0,03 | -1,26 -0,12 | 1,17 -0,08 | 3,51 -0,15 | 8,82 -0,34 | 15,51 -0,95 | 42,54 -1,55 |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,99 -0,07 | -1,80 -0,66 | 0,95 -0,29 | 3,06 -0,61 | 8,41 -0,76 | 15,49 -0,97 | 42,90 -1,19 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI | 0,33 123,44 | 0,51 52,84 | 0,60 87,61 | 1,13 99,33 | 1,56 71,67 | 10,63 148,61 | 21,64 154,76 |
| BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p. | 0,60 -0,09 | 0,82 -0,60 | 1,64 -0,27 | 2,61 -0,66 | 6,49 -0,91 | 16,54 -1,01 | 31,72 -1,38 |
| BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI | 0,30 109,41 | 1,09 112,70 | 0,76 111,51 | 1,31 115,46 | 2,33 106,80 | 6,53 91,26 | 13,22 94,52 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,28 105,11 | 0,99 102,20 | 0,73 106,60 | 1,24 109,65 | 2,28 104,53 | 6,64 92,82 | 13,30 95,08 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,24 90,08 | 0,85 87,75 | 0,61 89,22 | 1,21 107,18 | 2,14 98,08 | 6,48 90,50 | 13,10 93,65 |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p. | 1,41 0,02 | -3,18 0,17 | 0,69 0,04 | 4,04 0,13 | 10,51 -0,18 | 14,23 -1,07 | 50,94 -1,90 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI | 0,20 72,99 | 0,62 63,93 | 0,46 67,75 | 0,71 62,55 | 1,32 60,67 | 5,38 75,13 | 11,16 79,80 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 4,39 | 5,86 | 13,17 | 15,30 | 43,71 | 25,14 | 56,54 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,77 | -0,19 | -1,53 | -0,61 | -0,69 | -4,94 | -7,90 |
| BRADERCO F I A SELECTION | 5,99 | 3,57 | 9,76 | 11,75 | 44,03 | 18,59 | 51,10 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,17 | -2,48 | -4,94 | -4,15 | -0,38 | -11,48 | -13,35 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 6,62 | 10,25 | 16,55 | 18,63 | 53,35 | 49,70 | 84,59 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,47 | 4,21 | 1,85 | 2,72 | 8,94 | 19,62 | 20,15 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | 6,08 | 1,56 | 9,46 | 9,30 | 35,10 | 15,21 | 47,44 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,08 | -4,49 | -5,25 | -6,61 | -9,31 | -14,87 | -17,00 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 5,11 | 5,45 | 12,30 | 14,27 | 40,30 | 32,96 | 67,30 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,05 | -0,60 | -2,41 | -1,64 | -4,11 | 2,88 | 2,85 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | 6,30 | 5,19 | 15,49 | 13,26 | 32,84 | 12,17 | 46,72 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,15 | -0,86 | 0,78 | -2,65 | -11,57 | -17,91 | -17,73 |
| BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 8,31 | 12,54 | 16,53 | 22,23 | 41,90 | 45,69 | 93,92 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 2,15 | 6,49 | 1,83 | 6,32 | -2,51 | 15,61 | 29,48 |
| FIA BRASIL IBX-50 | 6,33 | 9,06 | 16,40 | 18,95 | 48,56 | 31,66 | 60,34 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,17 | 3,01 | 1,69 | 3,04 | 4,15 | 1,59 | -4,10 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 5,51 | 8,26 | 15,18 | 17,73 | 46,08 | 34,33 | 73,90 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,64 | 2,21 | 0,48 | 1,82 | 1,67 | 4,25 | 9,46 |
| BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS | 6,12 | 5,91 | 14,61 | 15,76 | 43,95 | 29,33 | 63,53 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,04 | -0,14 | -0,10 | -0,15 | -0,45 | -0,75 | -0,91 |
| ILHA SOLTEIRA | 2,39 | 1,81 | 4,91 | 6,81 | 16,13 | 19,15 | 41,66 |
| Var. IPCA + 5,89% p.p. | 1,08 | -3,83 | 1,33 | -0,79 | 1,74 | -4,23 | 4,96 |
| CDI | 0,27 | 0,97 | 0,68 | 1,13 | 2,18 | 7,16 | 13,98 |
| IBOVESPA | 6,16 | 6,05 | 14,70 | 15,91 | 44,41 | 30,08 | 64,44 |
| INPC + 6,00% | 1,45 | 5,80 | 3,74 | 7,89 | 15,40 | 24,81 | 38,59 |
| IPCA + 6,00% | 1,32 | 5,68 | 3,61 | 7,65 | 14,51 | 23,63 | 37,13 |

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 | 0,20 | 0,60 | 0,52 | 0,91 | 2,11 | 8,57 | 16,37 | 25,88 | 43,11 |
| IRF-M 1+ | 0,20 | -3,51 | -0,14 | -0,57 | -0,28 | 13,33 | 31,30 | 45,86 | 74,27 |
| IRF-M TOTAL | 0,20 | -1,79 | 0,19 | 0,13 | 0,71 | 12,10 | 27,04 | 40,22 | 64,99 |
| IMA-B 5 | 0,69 | 1,42 | 1,92 | 3,27 | 7,39 | 17,55 | 33,09 | 46,16 | 64,24 |
| IMA-B 5+ | 1,38 | -3,35 | 0,65 | 3,91 | 10,69 | 15,30 | 52,84 | 63,86 | 92,42 |
| IMA-B TOTAL | 1,06 | -1,14 | 1,25 | 3,66 | 9,17 | 16,46 | 44,09 | 56,66 | 80,66 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,50 | -0,66 | 0,61 | 1,45 | 3,33 | 11,00 | 26,04 | 37,48 | 59,06 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,61 | -0,21 | 0,73 | 1,81 | 4,20 | 12,11 | 27,53 | 39,29 | 60,68 |
| IDKA 2 | 0,88 | 2,19 | 2,53 | 3,96 | 8,47 | 18,26 | 32,51 | 46,64 | 65,76 |
| IDKA 20 | 2,37 | -4,65 | 0,81 | 6,18 | 15,79 | 13,16 | 71,22 | 79,58 | 122,22 |
| CDI | 0,27 | 0,97 | 0,68 | 1,13 | 2,18 | 7,16 | 13,98 | 22,72 | 38,97 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 6,16 | 6,05 | 14,70 | 15,91 | 44,41 | 30,08 | 64,44 | 101,27 | 160,39 |
| IBRX 100 | 5,92 | 8,14 | 15,50 | 18,03 | 47,63 | 34,45 | 72,38 | 109,11 | 171,70 |
| IBRX 50 | 6,18 | 8,39 | 15,91 | 18,61 | 49,33 | 32,34 | 65,03 | 102,41 | 160,17 |
| SMALL CAP | 6,32 | 10,00 | 16,04 | 18,26 | 57,75 | 55,08 | 97,90 | 135,01 | 241,15 |
| IFIX | -1,56 | -1,87 | -2,43 | 0,28 | 5,97 | 10,33 | 27,21 | 36,94 | 74,68 |
| Índice Consumo - ICON | 6,51 | 2,66 | 9,81 | 7,79 | 27,87 | 37,71 | 69,55 | 74,93 | 108,51 |
| Índice Dividendos - IDIV | 5,64 | 4,32 | 15,93 | 13,64 | 37,85 | 30,26 | 78,57 | 100,70 | 199,05 |

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 | 0,83 | 3,22 | 2,08 | 4,61 | 8,06 | 10,08 | 15,21 | 18,50 | 22,77 |
| INPC | 0,96 | 3,33 | 2,22 | 4,84 | 8,90 | 11,13 | 16,44 | 18,49 | 22,46 |
| IGPM | 4,10 | 14,39 | 8,77 | 15,49 | 37,04 | 45,96 | 57,11 | 63,81 | 66,39 |
| SELIC | 0,27 | 0,97 | 0,68 | 1,13 | 2,18 | 7,16 | 13,99 | 22,73 | 39,01 |

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 | -2,64 | 12,69 | 4,37 | 13,92 | 33,16 | 102,83 | 116,09 | 181,17 | 191,78 |
| MSCI ACWI | -1,84 | 10,84 | 2,43 | 12,92 | 34,65 | 91,95 | 95,33 | 147,44 | 157,20 |
| MSCI World | -1,95 | 11,37 | 3,24 | 13,05 | 33,59 | 93,08 | 98,36 | 151,08 | 158,61 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,16 | 4,87 | 3,11 | 6,65 | 12,36 | 19,03 | 29,54 | 38,50 | 49,22 |
| IPCA + 5,00% | 1,24 | 5,28 | 3,36 | 7,15 | 13,44 | 21,32 | 33,30 | 43,87 | 56,50 |
| IPCA + 5,50% | 1,28 | 5,48 | 3,48 | 7,40 | 13,97 | 22,47 | 35,20 | 46,62 | 60,24 |
| IPCA + 5,89% | 1,31 | 5,64 | 3,58 | 7,60 | 14,39 | 23,38 | 36,70 | 48,78 | 63,21 |
| IPCA + 6,00% | 1,32 | 5,68 | 3,61 | 7,65 | 14,51 | 23,63 | 37,13 | 49,40 | 64,06 |
| INPC + 4,00% | 1,29 | 4,99 | 3,24 | 6,88 | 13,23 | 20,16 | 30,92 | 38,49 | 48,86 |
| INPC + 6,00% | 1,45 | 5,80 | 3,74 | 7,89 | 15,40 | 24,81 | 38,59 | 49,39 | 63,66 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|--------------|------------|------------------|---------------|
| 44 | 03/05/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 50.000,00 | 13.290,37176360 | 3,7621220000 |
| 45 | 05/05/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 5.000,00 | 1.328,81147647 | 3,7627610000 |
| 46 | 06/05/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 15.000,00 | 3.986,11238445 | 3,7630650000 |
| 41 | 12/05/2021 | BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 1.100.000,00 | 0,00 | 88.744,94566272 | 12,3950721000 |
| 47 | 12/05/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 35.000,00 | 9.299,93046309 | 3,7634690000 |
| 49 | 19/05/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 70.000,00 | 18.585,84549799 | 3,7663070000 |
| 51 | 26/05/2021 | SANTANDER RF ATIVO FIC | 0,00 | 420.000,00 | 32.634,80146634 | 12,8696968000 |
| 40 | 27/05/2021 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 330.000,00 | 142.003,76410600 | 2,3238820610 |
| 42 | 27/05/2021 | BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 337.249,79 | 27.164,26535888 | 12,4152001000 |
| 43 | 27/05/2021 | BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 162.750,21 | 13.108,94779698 | 12,4152001000 |
| 50 | 27/05/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 120.000,00 | 31.827,88329458 | 3,7702790000 |
| Total | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 8.309.034,63

Value-At-Risk: 4,35%

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|-------|-------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,02 | 0,02 | 0,00 | -3,92 | 0,20 | 99.146,78 | 0,05 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,04 | 0,03 | -0,00 | 0,60 | 0,30 | 2.906.801,22 | 1,52 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,08 | 0,04 | 0,00 | 0,18 | 0,28 | 1.182.778,84 | 0,62 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,11 | 0,05 | 0,00 | -0,24 | 0,24 | 10.155.169,74 | 5,31 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,51 | 0,26 | 0,00 | 0,12 | 0,33 | 314.972,35 | 0,16 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,11 | 1,37 | 0,06 | 0,19 | 0,68 | 12.577.522,05 | 6,58 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,13 | 1,39 | 0,04 | 0,19 | 0,67 | 8.235.084,23 | 4,31 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,13 | 1,41 | 0,06 | 0,19 | 0,69 | 12.043.981,76 | 6,30 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | Artigo 7º IV, Alínea a | 2,30 | 1,54 | 0,07 | 0,15 | 0,60 | 12.880.246,68 | 6,74 |
| BB PREV RF IRF-M | Artigo 7º I, Alínea b | 2,50 | 1,49 | 0,01 | -0,04 | 0,16 | 1.875.126,97 | 0,98 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 5,03 | 2,97 | 0,14 | 0,15 | 1,04 | 13.209.615,69 | 6,91 |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR | Artigo 7º I, Alínea b | 5,04 | 2,97 | 0,21 | 0,15 | 1,03 | 19.604.573,85 | 10,25 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 5,06 | 2,97 | 0,17 | 0,16 | 1,05 | 15.760.670,39 | 8,24 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | Artigo 7º IV, Alínea a | 5,36 | 3,14 | 0,09 | 0,13 | 0,99 | 8.156.944,84 | 4,27 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | Artigo 7º IV, Alínea a | 7,83 | 4,39 | 0,07 | 0,15 | 1,41 | 4.579.806,85 | 2,40 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 7,92 | 4,49 | 0,15 | 0,14 | 1,39 | 10.259.648,88 | 5,37 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 14,31 | 9,97 | 0,20 | 0,42 | 6,30 | 4.141.909,61 | 2,17 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 14,52 | 11,94 | 0,28 | 0,28 | 4,39 | 4.810.357,08 | 2,52 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | Artigo 8º I, Alínea a | 15,86 | 12,05 | 0,73 | 0,37 | 6,12 | 12.278.507,90 | 6,42 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | Artigo 8º I, Alínea a | 15,93 | 12,16 | 0,19 | 0,33 | 5,51 | 3.120.542,30 | 1,63 |
| FIA BRASIL IBX-50 | Artigo 8º I, Alínea a | 16,07 | 13,07 | 0,75 | 0,38 | 6,33 | 11.950.086,14 | 6,25 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | Artigo 8º II, Alínea a | 16,32 | 10,37 | 0,20 | 0,30 | 5,11 | 3.878.104,84 | 2,03 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | Artigo 8º II, Alínea a | 16,35 | 11,15 | 0,07 | 0,35 | 6,08 | 1.239.786,90 | 0,65 |
| BRADESCO F I A SELECTION | Artigo 8º II, Alínea a | 16,47 | 12,72 | 0,28 | 0,35 | 5,99 | 4.729.453,02 | 2,47 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 17,53 | 12,08 | 0,22 | 0,36 | 6,62 | 4.084.512,99 | 2,14 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | Artigo 8º II, Alínea a | 18,26 | 12,00 | 0,37 | 0,44 | 8,31 | 7.110.905,34 | 3,72 |