



**LDB**  
EMPRESAS

**ILHA SOLTEIRA**  
SETEMBRO 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 19.01.2021.

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

75,00%

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                                | 6,00                | -0,66           | 4,32            | 1.550.562,32         | 0,89         | 4.983.832.924,90  | 0,03    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 12,72               | -1,56           | -0,93           | 14.888.136,10        | 8,54         | 5.533.318.681,28  | 0,27    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 12,79               | -1,53           | -1,00           | 12.483.967,71        | 7,16         | 5.834.527.804,73  | 0,21    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP  | 5,01                | -0,16           | 4,29            | 7.867.857,04         | 4,51         | 17.747.142.317,32 | 0,04    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI             | 5,03                | -0,14           | 4,37            | 12.012.313,81        | 6,89         | 1.117.588.180,49  | 1,07    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP   | 12,77               | -1,54           | -1,17           | 18.537.660,84        | 10,64        | 1.112.978.638,16  | 1,67    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,74               | -2,64           | -4,82           | 9.606.179,76         | 5,51         | 1.755.979.575,38  | 0,55    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                    | 4,98                | -0,15           | 4,30            | 11.499.185,74        | 6,60         | 4.406.252.863,92  | 0,26    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |           |   | <b>10,46</b>        | <b>-1,16</b>    | <b>0,42</b>     | <b>88.445.863,32</b> | <b>50,75</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 |
|---|-----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| SANTANDER                               | SANTANDER | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,31                | 0,04            | 1,46            | 10.319,09             | 0,01         | 1.693.031.076,47 | 0,00    |
| BRAM                                    | BRADESCO  | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM         | 0,23                | 0,11            | 1,71            | 4.100.922,15          | 2,35         | 3.791.411.661,08 | 0,11    |
| CEF                                     | CEF       | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 0,30                | -0,00           | 1,77            | 8.810.697,60          | 5,06         | 4.760.770.417,77 | 0,19    |
| BRAM                                    | BRADESCO  | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B       | 13,29               | -1,60           | -0,80           | 7.751.638,12          | 4,45         | 1.950.918.734,76 | 0,40    |
| BB                                      | BB        | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 0,17                | 0,02            | 1,82            | 3.010.101,91          | 1,73         | 2.533.726.732,47 | 0,12    |
| BRAM                                    | BRADESCO  | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+      | 19,85               | -2,59           | -5,30           | 4.285.864,34          | 2,46         | 240.348.297,77   | 1,78    |
| CEF                                     | CEF       | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,07                | 0,09            | 1,64            | 98.282,80             | 0,06         | 480.823.075,37   | 0,02    |
| BRAM                                    | BRADESCO  | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5                | 5,38                | -0,19           | 4,48            | 12.375.945,90         | 7,10         | 788.410.647,13   | 1,57    |
| SANTANDER                               | SANTANDER | SANTANDER RF ATIVO FIC                         | 1,13                | -0,23           | 1,93            | 1.819.447,82          | 1,04         | 1.154.190.584,67 | 0,16    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |           |  | <b>5,35</b>         | <b>-0,59</b>    | <b>1,40</b>     | <b>42.263.219,73</b>  | <b>24,25</b> |                  |         |
| <b>Renda Fixa</b>                       |           |  | <b>8,68</b>         | <b>-0,97</b>    | <b>0,77</b>     | <b>130.709.083,05</b> | <b>75,00</b> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,00%

## 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 | 44,29               | -4,81           | -18,40          | 9.221.705,75         | 5,29         | 339.715.925,19 | 2,71    |
| CEF                                    | CEF     | FIA BRASIL IBX-50         | 45,16               | -4,95           | -18,85          | 8.760.196,14         | 5,03         | 951.590.330,36 | 0,92    |
| BB                                     | BB      | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI    | 44,49               | -5,04           | -17,78          | 2.317.074,17         | 1,33         | 900.328.465,10 | 0,26    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b> |         |                           | <b>44,68</b>        | <b>-4,90</b>    | <b>-18,51</b>   | <b>20.298.976,06</b> | <b>11,65</b> |                |         |

## 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      | 42,98               | -4,27           | -20,98          | 1.026.889,46         | 0,59         | 543.611.577,48   | 0,19    |
| BRAM                                    | BEM       | BRDESCO F I A SELECTION                 | 43,47               | -2,74           | -20,15          | 3.785.510,04         | 2,17         | 689.497.036,46   | 0,55    |
| BB                                      | BB        | BB AÇÕES DIVIDENDOS                     | 38,48               | -4,70           | -23,62          | 3.266.367,15         | 1,87         | 890.322.162,57   | 0,37    |
| BRAM                                    | BEM       | BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS      | 43,55               | -5,04           | -14,61          | 5.499.979,95         | 3,16         | 1.999.773.052,56 | 0,28    |
| ITAU                                    | ITAU      | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 43,91               | -4,26           | -16,02          | 3.023.740,13         | 1,73         | 799.315.189,79   | 0,38    |
| CEF                                     | CEF       | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO              | 47,79               | -5,93           | -20,37          | 3.048.352,36         | 1,75         | 1.156.431.775,09 | 0,26    |
| BB                                      | BB        | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA                   | 42,87               | -4,38           | -21,59          | 3.628.272,41         | 2,08         | 406.655.961,35   | 0,89    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |           |   | <b>42,72</b>        | <b>-4,50</b>    | <b>-19,27</b>   | <b>23.279.111,50</b> | <b>13,36</b> |                  |         |

## Renda Variável e Investimentos Estruturados

43,51 -4,69 -18,94 43.578.087,56 25,00

## Total

15,64 -1,92 -4,80 174.287.170,61 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo   | Tipo de Ativo  | Valor(R\$)            | % Carteira   | Política de Investimentos |          |        |              |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
|  |  |                       |              | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>                                  |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 7º I, Alínea b                              | Fundos 100% Títulos Públicos                             | 88.445.863,32         | 50,75        | 20,00                     | 30,00    | 60,00  | 100,00       |
| Artigo 7º IV, Alínea a                             | Fundos de Renda Fixa                                     | 42.263.219,73         | 24,25        | 0,00                      | 30,00    | 40,00  | 40,00        |
|  | <b>Total Renda Fixa</b>                                  | <b>130.709.083,05</b> | <b>75,00</b> |                           |          |        | 100,00       |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 8º I, Alínea a                              | Fundos de Ações Referenciados                            | 20.298.976,06         | 11,65        | 0,00                      | 20,00    | 30,00  | 30,00        |
| Artigo 8º II, Alínea a                             | Fundos de Ações  | 23.279.111,50         | 13,36        | 0,00                      | 10,00    | 20,00  | 20,00        |
|  | <b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> | <b>43.578.087,56</b>  | <b>25,00</b> |                           |          |        | 30,00        |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

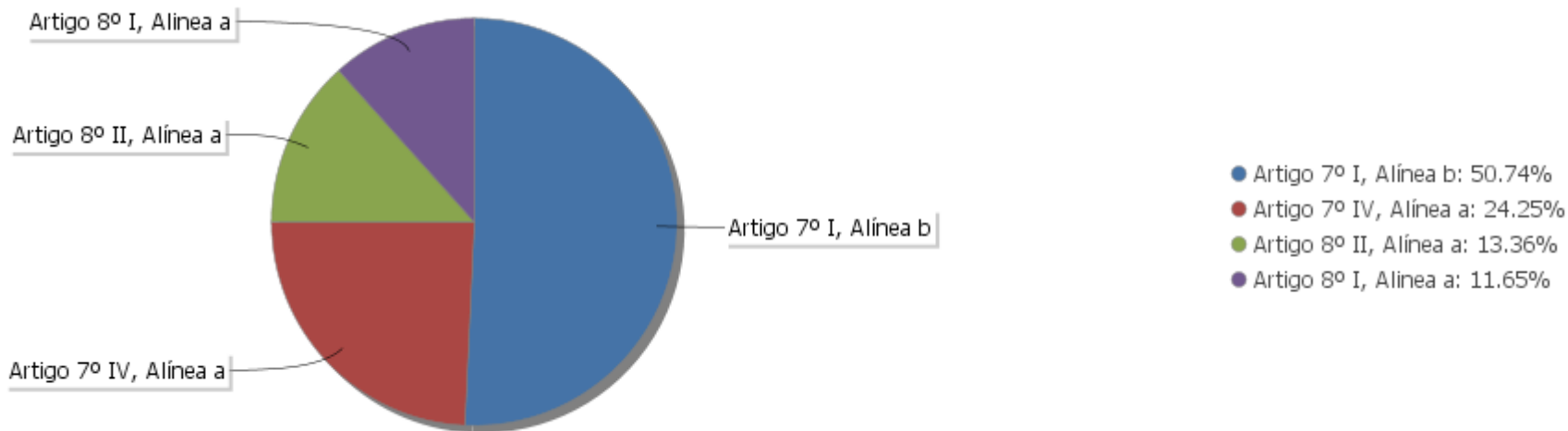
| Estratégia Indexador                         | No Mês           | No Ano          | 3 meses        | 6 meses        | 12 meses       | No Mês(R\$)          | No Ano(R\$)          |
|--|------------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | -1,16<br>-738,94 | 0,42<br>18,59   | 0,94<br>184,21 | 5,52<br>441,68 | 3,12<br>88,04  | -1.037.946,90        | 374.012,61           |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | -0,59<br>-378,05 | 1,40<br>61,46   | 0,74<br>144,15 | 3,54<br>282,65 | 3,43<br>96,74  | -262.947,97          | 593.423,47           |
| Artigo 8º I, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p.  | -4,90<br>-0,10   | -18,51<br>-0,31 | -0,52<br>-0,04 | 29,98<br>0,42  | -9,87<br>-0,18 | -1.045.052,82        | -4.558.633,28        |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -4,50<br>0,29    | -19,27<br>-1,07 | 1,21<br>1,68   | 29,85<br>0,29  | -8,92<br>0,76  | -1.097.962,00        | -5.513.757,94        |
| <b>ILHA SOLTEIRA (Total)</b>                 |                  |                 |                |                |                | <b>-3.443.909,69</b> | <b>-9.104.955,14</b> |

Análise de Liquidez

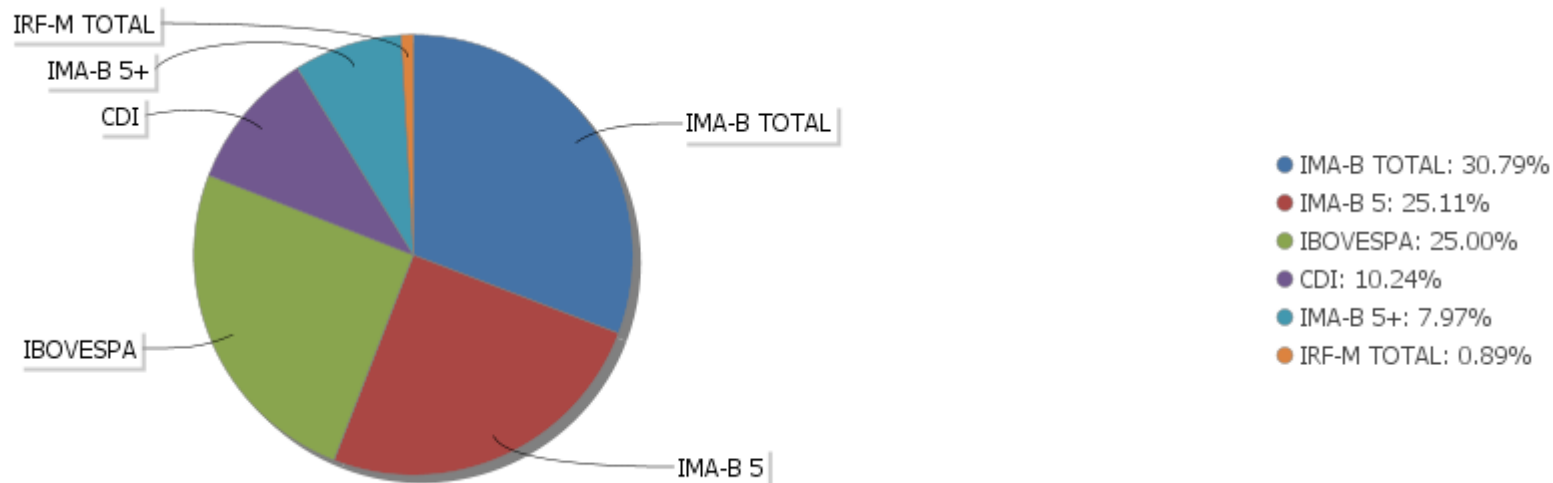
| Período           | Valor (R\$)    | (%)    | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 174.287.170,61 | 100,00 | 174.287.170,61        | 100,00    |
| de 31 a 364 dias  | 0,00           | 0,00   | 174.287.170,61        | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00           | 0,00   | 174.287.170,61        | 100,00    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

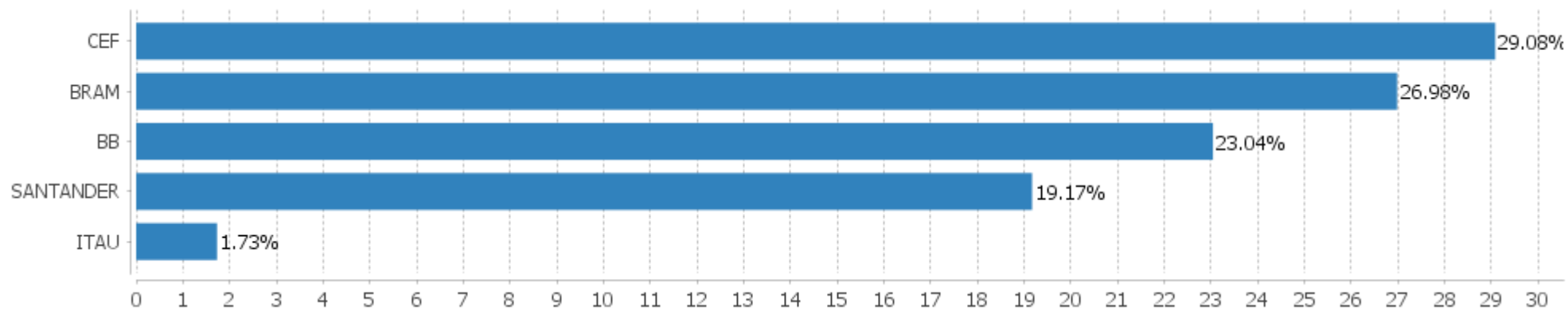


Alocação Por Estratégia



## 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           | 0,07  | -2,11 | -11,70 | 2,89  | 2,80  | 3,28  | 4,26 | -1,48 | -1,92 |       |       |      | -4,80     |
| IPCA + 5,89%   | 0,71  | 0,66  | 0,57   | 0,14  | 0,07  | 0,74  | 0,89 | 0,72  | 1,12  |       |       |      | 5,76      |
| p.p. indexador | -0,64 | -2,77 | -12,27 | 2,74  | 2,73  | 2,54  | 3,38 | -2,19 | -3,04 |       |       |      | -10,56    |
| 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%      | 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%      | 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%      | 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 TRIMESTRAL**

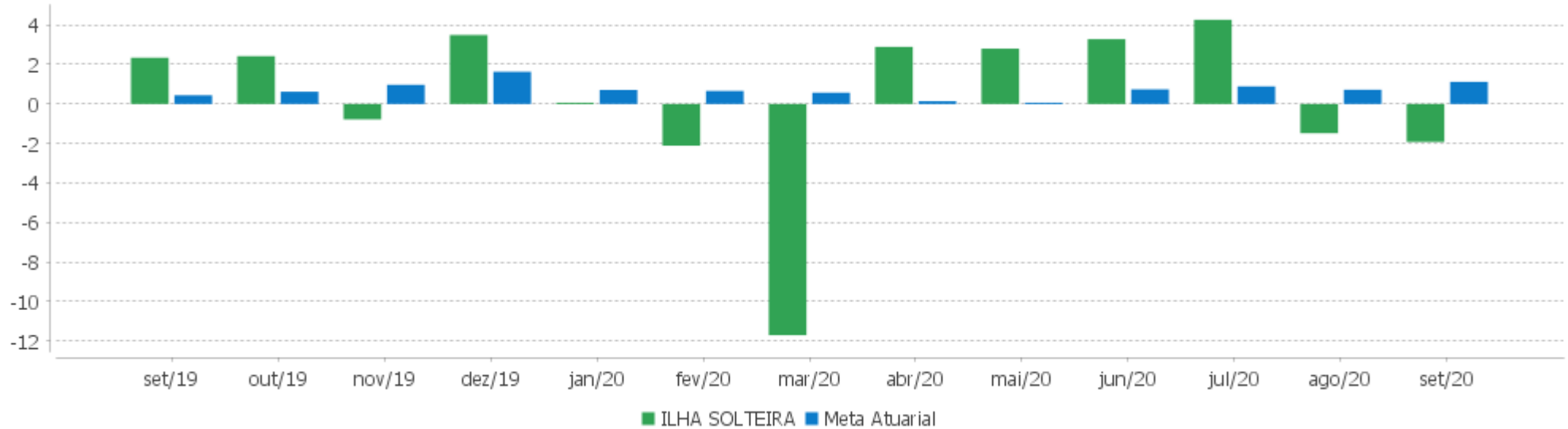
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 25         | 55,56     | 03 meses         | 0,75     | 2,75          | -2,00      | 8,06               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 20         | 44,44     | 06 meses         | 10,06    | 3,74          | 6,33       | 10,66              |
|                                 |            |           | 12 meses         | 0,13     | 9,24          | -9,11      | 15,64              |
|                                 |            |           | 24 meses         | 24,56    | 19,12         | 5,45       | 12,19              |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,90       | 2018-10   | 36 meses         | 29,73    | 31,89         | -2,15      | 10,50              |
| Menor rentabilidade da Carteira | -11,70     | 2020-03   | Desde 30/12/2016 | 44,88    | 40,20         | 4,68       | 9,86               |

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        |
|---|------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|-----------------|-----------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.     | -1,60<br>-0,09   | -0,80<br>-0,08 | 0,92<br>-0,04  | 6,12<br>0,15  | 2,03<br>-0,08  | 34,42<br>0,28   | 37,01<br>-0,55  |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5<br>Var. IMA-B 5 p.p.                  | -0,19<br>-0,06   | 4,48<br>-0,02  | 1,21<br>-0,08  | 5,10<br>-0,01 | 7,13<br>-0,11  | 23,57<br>-0,19  | 31,06<br>-0,78  |
| SANTANDER RF ATIVO FIC<br>% do CDI                                    | -0,23<br>-143,41 | 1,93<br>84,99  | -0,05<br>-8,89 | 1,22<br>97,87 | 4,33<br>122,14 | 18,61<br>185,39 | 22,63<br>130,35 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM<br>% do CDI                    | 0,11<br>72,39    | 1,71<br>75,26  | 0,55<br>107,65 | 1,08<br>86,27 | 2,90<br>81,72  | 9,28<br>92,41   | 16,46<br>94,83  |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                        | 0,02<br>15,30    | 1,82<br>79,94  | 0,44<br>86,28  | 1,22<br>97,65 | 2,98<br>84,04  | 9,27<br>92,40   | 16,58<br>95,53  |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI             | -0,00<br>-1,68   | 1,77<br>77,58  | 0,39<br>76,38  | 0,97<br>77,46 | 2,90<br>81,81  | 9,20<br>91,67   | 16,28<br>93,76  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+<br>Var. IMA-B 5+ p.p.       | -2,59<br>0,01    | -5,30<br>-0,75 | 0,65<br>-0,10  | 6,52<br>-0,26 | -2,47<br>-0,79 | 40,56<br>-1,86  | 39,11<br>-2,15  |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI<br>% do CDI            | 0,04<br>28,36    | 1,46<br>64,38  | 0,56<br>108,71 | 0,88<br>70,10 | 2,58<br>72,93  | 9,02<br>89,88   | 16,18<br>93,19  |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF<br>% do CDI                       | 0,09<br>55,34    | 1,64<br>71,97  | 0,29<br>57,43  | 0,83<br>66,45 | 2,68<br>75,66  | 8,21<br>81,83   | 14,47<br>83,39  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | -1,53<br>-0,02   | -1,00<br>-0,28 | 0,89<br>-0,07  | 5,84<br>-0,12 | 1,68<br>-0,43  | 33,36<br>-0,78  | 36,41<br>-1,16  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.   | -0,16<br>-0,04   | 4,29<br>-0,22  | 1,21<br>-0,09  | 4,96<br>-0,15 | 6,91<br>-0,33  | 23,18<br>-0,58  | 30,91<br>-0,93  |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.              | -0,14<br>-0,02   | 4,37<br>-0,14  | 1,23<br>-0,07  | 5,00<br>-0,11 | 7,04<br>-0,20  | 23,28<br>-0,48  | 31,08<br>-0,76  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.                     | -0,15<br>-0,03   | 4,30<br>-0,20  | 1,18<br>-0,11  | 4,93<br>-0,17 | 6,95<br>-0,29  | 23,16<br>-0,59  | 30,94<br>-0,89  |
| BB PREV RF IRF-M<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.                             | -0,66<br>-0,10   | 4,32<br>-0,30  | -0,35<br>-0,11 | 2,90<br>-0,25 | 6,21<br>-0,35  | 23,82<br>-0,67  | 30,66<br>-0,98  |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.         | -1,56<br>-0,04   | -0,93<br>-0,21 | 0,83<br>-0,13  | 5,77<br>-0,20 | 1,83<br>-0,28  | 33,39<br>-0,75  | 36,49<br>-1,07  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p. | -2,64<br>-0,04   | -4,82<br>-0,27 | 0,65<br>-0,10  | 6,56<br>-0,22 | -2,10<br>-0,43 | 40,97<br>-1,45  | 39,57<br>-1,69  |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP                         | -1,54            | -1,17          | 0,88           | 5,75          | 1,58           | 33,11           | 36,13           |

## 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-B TOTAL p.p.                          | -0,03        | -0,45         | -0,08        | -0,21        | -0,53         | -1,03        | -1,43        |
| <b>BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA</b>                   | <b>-4,38</b> | <b>-21,59</b> | <b>-0,62</b> | <b>27,14</b> | <b>-12,24</b> | <b>12,08</b> | <b>22,35</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 0,42         | -3,40         | -0,14        | -2,42        | -2,56         | -7,15        | -4,99        |
| <b>BRADESCO F I A SELECTION</b>                | <b>-2,74</b> | <b>-20,15</b> | <b>5,81</b>  | <b>32,85</b> | <b>-12,72</b> | <b>15,23</b> | <b>31,92</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 2,06         | -1,95         | 6,28         | 3,29         | -3,04         | -4,00        | 4,58         |
| <b>FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO</b>              | <b>-5,93</b> | <b>-20,37</b> | <b>1,37</b>  | <b>33,48</b> | <b>-4,18</b>  | <b>45,25</b> | <b>33,42</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | -1,13        | -2,18         | 1,85         | 3,92         | 5,51          | 26,01        | 6,08         |
| <b>SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES</b>      | <b>-4,27</b> | <b>-20,98</b> | <b>2,37</b>  | <b>31,68</b> | <b>-11,99</b> | <b>20,08</b> | <b>24,09</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 0,52         | -2,79         | 2,85         | 2,12         | -2,31         | 0,85         | -3,25        |
| <b>ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI</b> | <b>-4,26</b> | <b>-16,02</b> | <b>0,71</b>  | <b>31,74</b> | <b>-5,26</b>  | <b>30,94</b> | <b>33,21</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 0,53         | 2,17          | 1,18         | 2,18         | 4,42          | 11,70        | 5,88         |
| <b>BB AÇÕES DIVIDENDOS</b>                     | <b>-4,70</b> | <b>-23,62</b> | <b>-1,71</b> | <b>18,99</b> | <b>-16,46</b> | <b>13,75</b> | <b>13,73</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 0,10         | -5,43         | -1,24        | -10,57       | -6,77         | -5,49        | -13,61       |
| <b>BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS</b>     | <b>-5,04</b> | <b>-14,61</b> | <b>1,16</b>  | <b>33,49</b> | <b>-1,67</b>  | <b>48,47</b> | <b>60,05</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | -0,24        | 3,59          | 1,63         | 3,94         | 8,01          | 29,23        | 32,71        |
| <b>FIA BRASIL IBX-50</b>                       | <b>-4,95</b> | <b>-18,85</b> | <b>-0,51</b> | <b>30,59</b> | <b>-10,27</b> | <b>14,44</b> | <b>21,57</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | -0,16        | -0,65         | -0,03        | 1,03         | -0,59         | -4,79        | -5,76        |
| <b>BB AÇÕES GOVERNANÇA FI</b>                  | <b>-5,04</b> | <b>-17,78</b> | <b>-0,39</b> | <b>30,27</b> | <b>-8,20</b>  | <b>24,95</b> | <b>26,70</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | -0,25        | 0,41          | 0,09         | 0,71         | 1,48          | 5,72         | -0,63        |
| <b>BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS</b>              | <b>-4,81</b> | <b>-18,40</b> | <b>-0,56</b> | <b>29,33</b> | <b>-9,91</b>  | <b>18,74</b> | <b>26,56</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | -0,01        | -0,20         | -0,08        | -0,23        | -0,23         | -0,49        | -0,78        |
| <b>ILHA SOLTEIRA</b>                           | <b>-1,92</b> | <b>-4,80</b>  | <b>0,75</b>  | <b>10,06</b> | <b>0,13</b>   | <b>24,56</b> | <b>29,73</b> |
| Var. IPCA + 5,89% p.p.                         | -3,04        | -10,56        | -2,00        | 6,33         | -9,08         | 5,60         | -1,85        |
| CDI  | 0,16         | 2,28          | 0,51         | 1,25         | 3,54          | 10,04        | 17,36        |
| IBOVESPA                                       | -4,80        | -18,20        | -0,48        | 29,56        | -9,68         | 19,23        | 27,34        |
| INPC + 6%                                      | 1,36         | 6,58          | 3,22         | 4,50         | 10,12         | 20,11        | 32,29        |
| IPCA + 6%                                      | 1,13         | 5,85          | 2,78         | 3,79         | 9,32          | 19,21        | 31,99        |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

| Indexador                     | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| <b>Renda Fixa</b>             |        |        |         |         |          |          |          |
| IRF-M 1                       | 0,15   | 3,12   | 0,51    | 1,66    | 4,54     | 12,32    | 19,91    |
| IRF-M 1+                      | -0,91  | 5,40   | -0,59   | 3,90    | 7,61     | 30,00    | 36,94    |
| IRF-M TOTAL                   | -0,56  | 4,62   | -0,24   | 3,15    | 6,56     | 24,50    | 31,64    |
| IMA-B 5                       | -0,12  | 4,51   | 1,30    | 5,11    | 7,24     | 23,75    | 31,84    |
| IMA-B 5+                      | -2,60  | -4,56  | 0,75    | 6,78    | -1,67    | 42,42    | 41,26    |
| IMA-B TOTAL                   | -1,51  | -0,72  | 0,96    | 5,97    | 2,11     | 34,14    | 37,56    |
| IMA-C TOTAL                   | 2,95   | 17,78  | 9,60    | 18,32   | 19,95    | 48,39    | 67,40    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | -0,71  | 1,96   | 0,25    | 2,99    | 3,90     | 21,11    | 27,38    |
| IMA-GERAL TOTAL               | -0,60  | 2,41   | 0,53    | 3,43    | 4,35     | 21,85    | 28,42    |
| IDKA 2                        | 0,02   | 5,41   | 1,99    | 5,41    | 8,00     | 21,88    | 32,26    |
| IDKA 20                       | -4,30  | -11,82 | 0,58    | 7,11    | -8,89    | 56,79    | 46,43    |
| CDI                           | 0,16   | 2,28   | 0,51    | 1,25    | 3,54     | 10,04    | 17,36    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | -4,80  | -18,20 | -0,48   | 29,56   | -9,68    | 19,23    | 27,34    |
| IBRX 100                      | -4,58  | -17,42 | -0,04   | 30,33   | -8,59    | 23,26    | 30,47    |
| IBRX 50                       | -4,62  | -18,06 | -0,37   | 31,30   | -10,02   | 16,09    | 24,57    |
| SMALL CAP                     | -5,44  | -18,93 | 2,27    | 35,50   | -1,78    | 54,49    | 42,68    |
| IFIX                          | 0,46   | -12,59 | -0,41   | 12,06   | 4,12     | 30,92    | 25,84    |
| Índice Consumo - ICON         | -3,96  | -9,26  | 1,83    | 42,00   | -1,04    | 53,03    | 27,90    |
| Índice Dividendos - IDIV      | -4,63  | -21,08 | -3,31   | 14,78   | -9,81    | 37,85    | 30,49    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,64   | 1,34   | 1,24    | 0,81    | 3,14     | 6,12     | 10,92    |
| INPC                          | 0,87   | 2,04   | 1,68    | 1,49    | 3,89     | 6,93     | 11,17    |
| IGPM                          | 4,34   | 14,40  | 9,59    | 12,51   | 17,94    | 21,91    | 34,14    |
| SELIC                         | 0,16   | 2,28   | 0,51    | 1,25    | 3,54     | 10,04    | 17,37    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

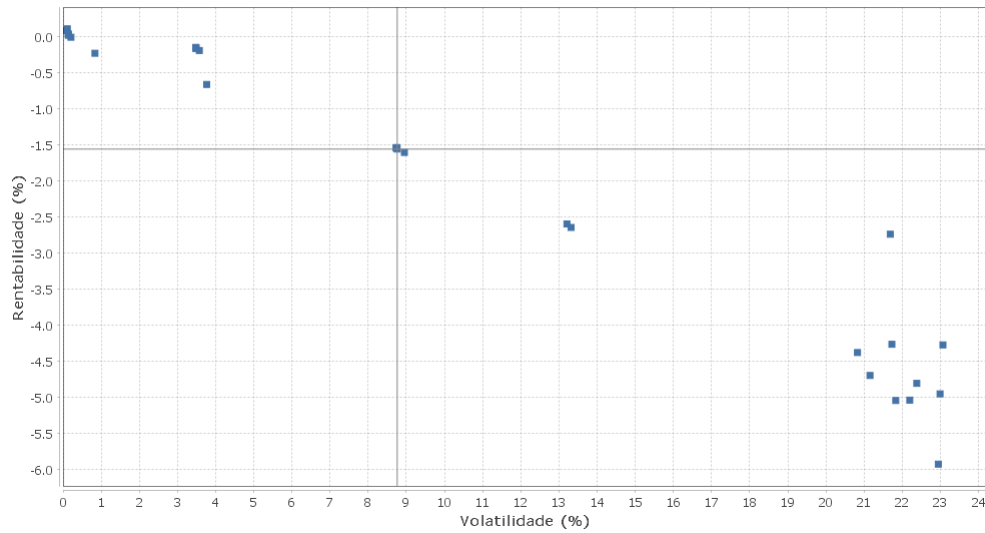
| APR | Data       | Ativo   | Aplicação  | Resgate    | Quantidade       | Valor Cota    |
|-----|------------|---|------------|------------|------------------|---------------|
| 70  | 16/09/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 950.000,00 | 0,00       | 414.971,09441000 | 2,2893160820  |
| 73  | 25/09/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00       | 15.000,00  | 4.034,65284500   | 3,7177920000  |
| 71  | 28/09/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 0,00       | 260.000,00 | 113.570,17778600 | 2,2893333890  |
| 74  | 28/09/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00       | 180.000,00 | 48.426,20133300  | 3,7169960000  |
| 75  | 28/09/2020 | SANTANDER RF ATIVO FIC                        | 0,00       | 420.000,00 | 33.013,72795800  | 12,7219804000 |
| 72  | 30/09/2020 | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM        | 0,00       | 520.000,00 | 42.500,19600000  | 12,2352376000 |

**Total**

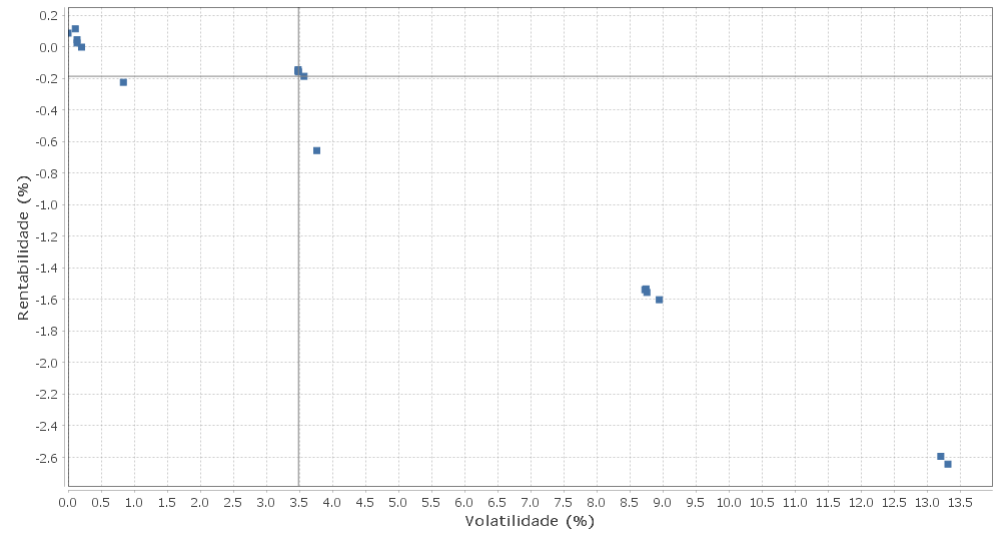
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

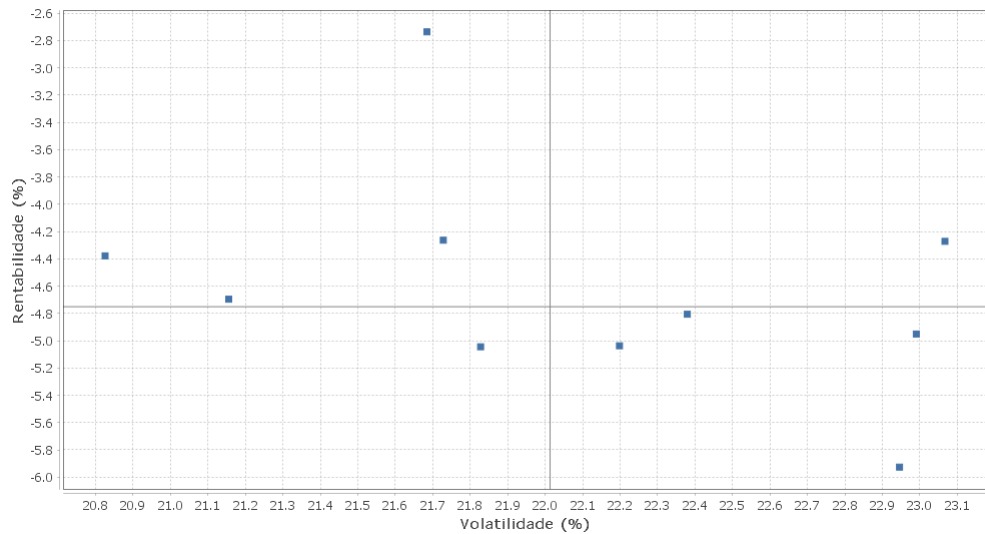
ILHA SOLTEIRA - No Mês



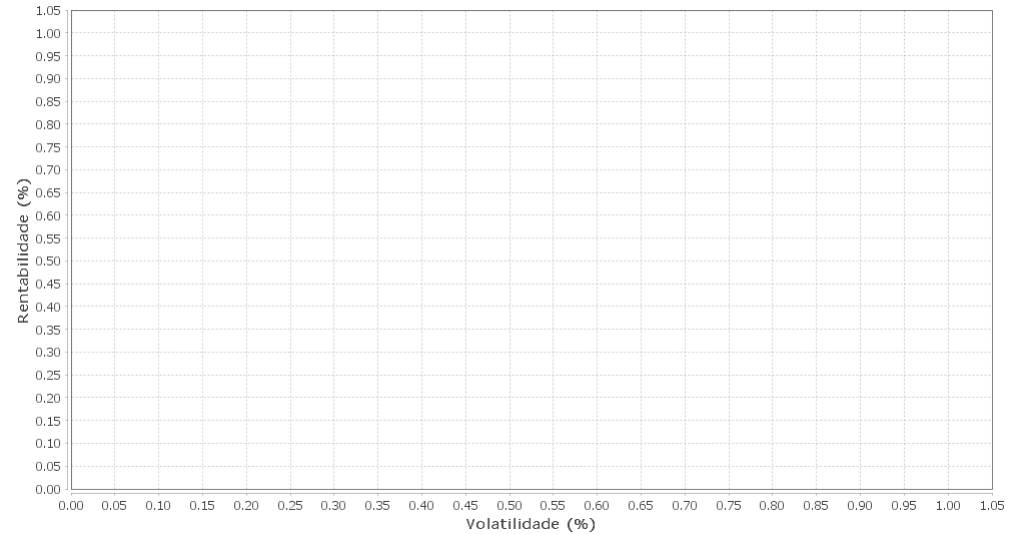
Renda Fixa - No Mês



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\$): 7.105.691,67

Value-At-Risk: 4,08%

| Ativo   | Estratégia             | Volatilidade | VaR   | CVaR  | Sharpe  | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|-------|-------|---------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF             | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,00         | 0,01  | 0,00  | -140,08 | 0,09  | 98.282,80     | 0,06       |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM          | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,11         | 0,05  | -0,00 | -0,39   | 0,11  | 4.100.922,15  | 2,35       |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI  | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,14         | 0,07  | 0,00  | -0,82   | 0,04  | 10.319,09     | 0,01       |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI              | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,14         | 0,06  | 0,00  | -0,97   | 0,02  | 3.010.101,91  | 1,73       |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP   | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,21         | 0,08  | 0,00  | -0,78   | -0,00 | 8.810.697,60  | 5,06       |
| SANTANDER RF ATIVO FIC                          | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,84         | 0,40  | 0,00  | -0,46   | -0,23 | 1.819.447,82  | 1,04       |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                    | Artigo 7º I, Alínea b  | 3,48         | 1,03  | 0,05  | -0,09   | -0,15 | 11.499.185,74 | 6,60       |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI             | Artigo 7º I, Alínea b  | 3,48         | 1,01  | 0,05  | -0,09   | -0,14 | 12.012.313,81 | 6,89       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP  | Artigo 7º I, Alínea b  | 3,49         | 1,02  | 0,03  | -0,09   | -0,16 | 7.867.857,04  | 4,51       |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5                 | Artigo 7º IV, Alínea a | 3,57         | 1,07  | 0,05  | -0,10   | -0,19 | 12.375.945,90 | 7,10       |
| BB PREV RF IRF-M                                | Artigo 7º I, Alínea b  | 3,76         | 1,34  | 0,01  | -0,22   | -0,66 | 1.550.562,32  | 0,89       |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP   | Artigo 7º I, Alínea b  | 8,73         | 3,23  | 0,29  | -0,19   | -1,54 | 18.537.660,84 | 10,64      |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | Artigo 7º I, Alínea b  | 8,75         | 3,24  | 0,20  | -0,19   | -1,53 | 12.483.967,71 | 7,16       |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | Artigo 7º I, Alínea b  | 8,76         | 3,22  | 0,23  | -0,20   | -1,56 | 14.888.136,10 | 8,54       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B        | Artigo 7º IV, Alínea a | 8,95         | 3,31  | 0,12  | -0,20   | -1,60 | 7.751.638,12  | 4,45       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+       | Artigo 7º IV, Alínea a | 13,21        | 5,06  | 0,10  | -0,21   | -2,59 | 4.285.864,34  | 2,46       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b  | 13,32        | 5,13  | 0,24  | -0,21   | -2,64 | 9.606.179,76  | 5,51       |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA                           | Artigo 8º II, Alínea a | 20,83        | 10,55 | 0,21  | -0,22   | -4,38 | 3.628.272,41  | 2,08       |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                             | Artigo 8º II, Alínea a | 21,16        | 11,35 | 0,20  | -0,23   | -4,70 | 3.266.367,15  | 1,87       |
| BRADESCO F I A SELECTION                        | Artigo 8º II, Alínea a | 21,68        | 11,03 | 0,21  | -0,13   | -2,74 | 3.785.510,04  | 2,17       |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI         | Artigo 8º II, Alínea a | 21,73        | 10,79 | 0,18  | -0,20   | -4,26 | 3.023.740,13  | 1,73       |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                          | Artigo 8º I, Alínea a  | 21,83        | 11,24 | 0,14  | -0,24   | -5,04 | 2.317.074,17  | 1,33       |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS             | Artigo 8º II, Alínea a | 22,20        | 11,47 | 0,33  | -0,23   | -5,04 | 5.499.979,95  | 3,16       |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS                      | Artigo 8º I, Alínea a  | 22,38        | 11,57 | 0,57  | -0,22   | -4,81 | 9.221.705,75  | 5,29       |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                      | Artigo 8º II, Alínea a | 22,95        | 15,77 | 0,25  | -0,27   | -5,93 | 3.048.352,36  | 1,75       |
| FIA BRASIL IBX-50                               | Artigo 8º I, Alínea a  | 22,99        | 11,46 | 0,54  | -0,22   | -4,95 | 8.760.196,14  | 5,03       |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES              | Artigo 8º II, Alínea a | 23,07        | 11,01 | 0,06  | -0,19   | -4,27 | 1.026.889,46  | 0,59       |