



**LDB**  
EMPRESAS

**ILHA SOLTEIRA**  
ABRIL 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.04.2024.

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

76,16%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

| Gestor                                 | Admin.    | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |              | Valor (R\$)          | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|--|-----------|---|---------------------|-------------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
|  |           |   |                     | Dia               | Mês          | Ano          |                      |              |                  |         |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 3,91                | -0,62             | -1,63        | -1,53        | 6.319.969,63         | 3,07         | 5.056.024.851,42 | 0,12    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                    | 1,75                | -0,17             | -0,22        | 1,77         | 7.225.842,84         | 3,51         | 5.149.829.191,06 | 0,14    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IRF M                                | 2,29                | -0,34             | -0,56        | 1,04         | 2.797.347,16         | 1,36         | 4.126.258.083,34 | 0,07    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP  | 1,74                | -0,17             | -0,22        | 1,78         | 7.283.655,50         | 3,54         | 7.735.992.731,60 | 0,09    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,99                | -1,03             | -2,91        | -4,39        | 2.707.653,44         | 1,32         | 1.272.326.488,36 | 0,21    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 3,89                | -0,62             | -1,64        | -1,51        | 6.310.878,96         | 3,07         | 4.738.343.434,12 | 0,13    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI             | 1,75                | -0,17             | -0,22        | 1,77         | 16.153.144,73        | 7,85         | 1.283.166.630,03 | 1,26    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR      | 3,92                | -0,62             | -1,64        | -1,53        | 23.649.128,41        | 11,49        | 532.026.369,86   | 4,45    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |           |   | <b>2,92</b>         | <b>-0,44</b>      | <b>-1,05</b> | <b>-0,17</b> | <b>72.447.620,67</b> | <b>35,20</b> |                  |         |

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

| Gestor                                   | Admin.    | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|-----------|---|---------------------|-------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
|  |           |   |                     | Dia               | Mês          | Ano         |                       |              |                   |         |
| BB                                       | BB        | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                      | 0,07                | 0,04              | 0,88         | 3,55        | 20.153.127,03         | 9,79         | 16.797.040.223,44 | 0,12    |
| BRDESCO                                  | BRDESCO   | BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM                   | 0,10                | 0,04              | 0,95         | 3,90        | 19.050.623,76         | 9,26         | 11.563.181.980,10 | 0,16    |
| CAIXA DTVM                               | CEF       | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP           | 0,08                | 0,04              | 0,89         | 3,64        | 31.617.878,63         | 15,36        | 15.720.644.238,34 | 0,20    |
| CAIXA DTVM                               | CEF       | FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES | 0,06                | 0,04              | 0,80         | 3,19        | 129.586,58            | 0,06         | 1.048.477.905,07  | 0,01    |
| SANTANDER                                | SANTANDER | SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI        | 0,10                | 0,04              | 0,94         | 3,76        | 13.357.833,08         | 6,49         | 2.900.137.907,64  | 0,46    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |           |   | <b>0,07</b>         | <b>0,04</b>       | <b>0,91</b>  | <b>3,69</b> | <b>84.309.049,08</b>  | <b>40,96</b> |                   |         |
| <b>Renda Fixa</b>                        |           |   | <b>1,36</b>         | <b>-0,18</b>      | <b>-0,00</b> | <b>1,88</b> | <b>156.756.669,75</b> | <b>76,16</b> |                   |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

23,84%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor                       | Admin.    | Ativo                                   | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |              | Valor (R\$)           | % Carteira    | PL do Fundo    | % Fundo |
|------------------------------|-----------|---|---------------------|-------------------|--------------|--------------|-----------------------|---------------|----------------|---------|
|                              |           |   |                     | Dia               | Mês          | Ano          |                       |               |                |         |
| BB                           | BB        | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA                   | 14,28               | -1,29             | -2,27        | -7,60        | 4.275.310,32          | 2,08          | 320.731.770,13 | 1,33    |
| BB                           | BB        | BB AÇÕES DIVIDENDOS                     | 13,36               | -0,84             | -2,16        | -6,28        | 3.752.474,17          | 1,82          | 563.931.238,10 | 0,67    |
| BB                           | BB        | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                  | 14,78               | -1,17             | -1,50        | -5,62        | 2.778.119,90          | 1,35          | 712.088.894,91 | 0,39    |
| BRAM                         | BEM       | BRADERSCO F I A SELECTION               | 15,30               | -2,07             | -6,73        | -9,55        | 4.102.911,00          | 1,99          | 371.277.783,63 | 1,11    |
| BRAM                         | BEM       | BRADERSCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS    | 20,06               | -1,46             | -7,91        | -12,59       | 4.729.180,67          | 2,30          | 591.352.904,26 | 0,80    |
| BRAM                         | BRADERSCO | BRADERSCO FIA IBOVESPA PLUS             | 14,59               | -1,12             | -1,74        | -6,26        | 12.230.078,59         | 5,94          | 233.849.086,93 | 5,23    |
| CAIXA DTVM                   | CEF       | FIA BRASIL IBX-50                       | 14,50               | -1,14             | -1,42        | -5,50        | 9.994.195,99          | 4,86          | 404.818.553,65 | 2,47    |
| CAIXA DTVM                   | CEF       | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO              | 20,25               | -2,04             | -7,83        | -11,77       | 2.671.124,75          | 1,30          | 627.807.911,11 | 0,43    |
| ITAU                         | ITAU      | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 14,36               | -1,37             | -3,48        | -7,63        | 3.531.277,22          | 1,72          | 340.410.247,50 | 1,04    |
| SANTANDER                    | SANTANDER | SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES      | 14,72               | -1,34             | -3,40        | -8,92        | 998.920,52            | 0,49          | 64.537.921,28  | 1,55    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I</b> |           |   | <b>14,94</b>        | <b>-1,30</b>      | <b>-3,30</b> | <b>-7,58</b> | <b>49.063.593,13</b>  | <b>23,84</b>  |                |         |
| <b>Renda Variável</b>        |           |   | <b>14,94</b>        | <b>-1,30</b>      | <b>-3,30</b> | <b>-7,58</b> | <b>49.063.593,13</b>  | <b>23,84</b>  |                |         |
| <b>Total</b>                 |           |   | <b>4,26</b>         | <b>-0,45</b>      | <b>-0,81</b> | <b>-0,55</b> | <b>205.820.262,88</b> | <b>100,00</b> |                |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo                  | Tipo de Ativo                | Valor(R\$)            | % Carteira    | Política de Investimentos |          |        | Pró-Gestão Nível 1 |              |
|-------------------------|------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|--------------|
|                         |                              |                       |               | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | ALM                | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>       |                              |                       |               |                           |          |        |                    |              |
| Artigo 7º I, Alínea b   | Fundos 100% Títulos Públicos | 72.447.620,67         | 35,20         |                           |          |        |                    | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa            | 84.309.049,08         | 40,96         |                           |          |        |                    | 65,00        |
|                         | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>156.756.669,75</b> | <b>76,16</b>  |                           |          |        |                    | 100,00       |
| <b>Renda Variável</b>   |                              |                       |               |                           |          |        |                    |              |
| Artigo 8º I             | Fundos de Ações              | 49.063.593,13         | 23,84         |                           |          |        |                    | 35,00        |
|                         | <b>Total Renda Variável</b>  | <b>49.063.593,13</b>  | <b>23,84</b>  |                           |          |        |                    | 35,00        |
| <b>Total</b>            |                              | <b>205.820.262,88</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |                    |              |

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   | -1,05<br>-118,22 | -0,17<br>-4,86 | -0,17<br>-6,77 | 4,34<br>80,11  | 7,92<br>64,23   | -768.089,42          | -124.685,55          |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 0,91<br>102,55   | 3,69<br>104,44 | 2,65<br>104,04 | 5,65<br>104,22 | 12,91<br>104,76 | 762.666,78           | 3.026.280,07         |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -3,30<br>-1,60   | -7,58<br>-1,43 | -2,88<br>-1,45 | 9,21<br>-2,09  | 15,39<br>-5,19  | -1.676.496,02        | -4.026.071,52        |
| <b>ILHA SOLTEIRA (Total)</b>        |                  |                |                |                |                 | <b>-1.681.918,66</b> | <b>-1.124.477,00</b> |

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 6.424.855,78   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 6.319.969,63  | -104.886,15                 | -98.075,67                  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                    | 7.242.062,73   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 7.225.842,84  | -16.219,89                  | 125.815,14                  |
| BB PREV RF IRF M                                | 2.812.973,43   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.797.347,16  | -15.626,27                  | 28.889,01                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP  | 7.299.756,51   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 7.283.655,50  | -16.101,01                  | 127.486,03                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2.788.833,72   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.707.653,44  | -81.180,28                  | -124.252,23                 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 6.415.829,44   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 6.310.878,96  | -104.950,48                 | -96.796,62                  |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI             | 16.189.025,86  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 16.153.144,73 | -35.881,13                  | 280.440,24                  |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR      | 24.042.372,62  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 23.649.128,41 | -393.244,21                 | -368.191,45                 |
|   | 73.215.710,09  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 72.447.620,67 | -768.089,42                 |                             |

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

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates    | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|--------------|-------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                      | 20.436.373,35  | 0,00         | -460.000,00 | 0,00        | 20.153.127,03 | 176.753,68                  | 716.583,60                  |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM                  | 18.190.425,04  | 1.400.000,00 | -720.000,00 | 0,00        | 19.050.623,76 | 180.198,72                  | 737.372,08                  |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP           | 31.608.287,95  | 0,00         | -270.000,00 | 0,00        | 31.617.878,63 | 279.590,68                  | 1.116.653,33                |
| FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES | 128.559,42     | 0,00         | 0,00        | 0,00        | 129.586,58    | 1.027,16                    | 4.007,11                    |
| SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI        | 14.042.736,54  | 0,00         | -810.000,00 | 0,00        | 13.357.833,08 | 125.096,54                  | 451.663,95                  |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates      | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------|----------------|--------------|---------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
|       | 84.406.382,30  | 1.400.000,00 | -2.260.000,00 | 0,00        | 84.309.049,08 | 762.666,78                  |                             |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo                                   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA                   | 4.374.573,36   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.275.310,32  | -99.263,04                  | -351.668,31                 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                     | 3.835.303,84   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.752.474,17  | -82.829,67                  | -251.363,16                 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                  | 2.820.515,44   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.778.119,90  | -42.395,54                  | -165.512,82                 |
| BRADESCO F I A SELECTION                | 4.399.024,84   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.102.911,00  | -296.113,84                 | -433.148,16                 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS     | 5.135.272,73   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.729.180,67  | -406.092,06                 | -680.864,65                 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS              | 12.446.220,65  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 12.230.078,59 | -216.142,06                 | -816.181,39                 |
| FIA BRASIL IBX-50                       | 10.138.458,14  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.994.195,99  | -144.262,15                 | -581.832,83                 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO              | 2.898.080,02   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.671.124,75  | -226.955,27                 | -356.188,19                 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 3.658.595,42   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.531.277,22  | -127.318,20                 | -291.503,61                 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES      | 1.034.044,71   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 998.920,52    | -35.124,19                  | -97.808,40                  |
|   | 50.740.089,15  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 49.063.593,13 | -1.676.496,02               |                             |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

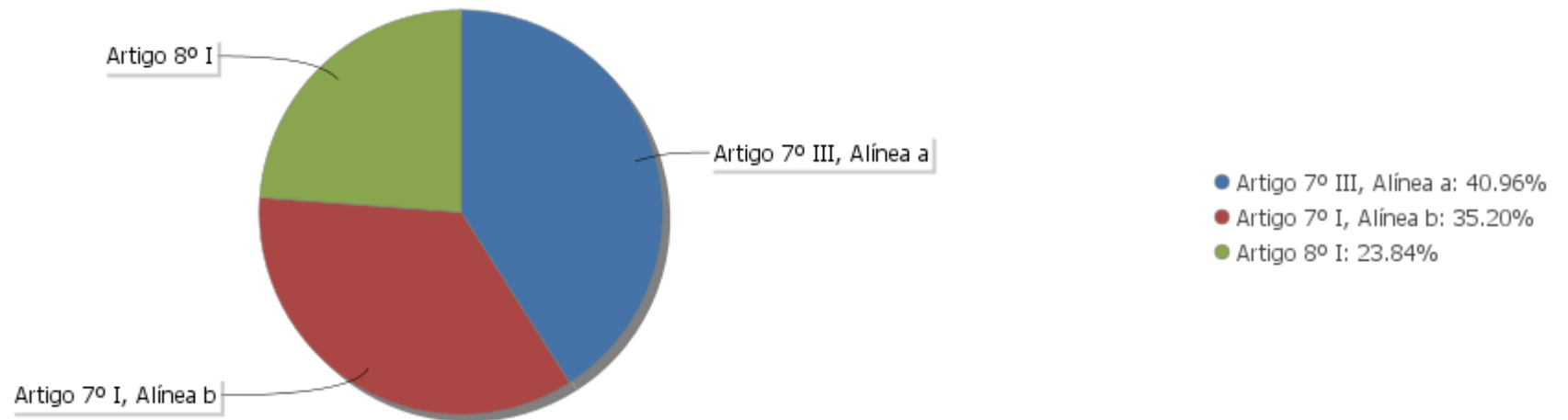
## Análise de Liquidez

| Período               | Valor (R\$)    | (%)    | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|----------------|--------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 205.820.262,88 | 100,00 |                        | 205.820.262,88        | 100,00    |                         |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00           | 0,00   |                        | 205.820.262,88        | 100,00    |                         |
| acima de 365 dias     | 0,00           | 0,00   |                        | 205.820.262,88        | 100,00    |                         |

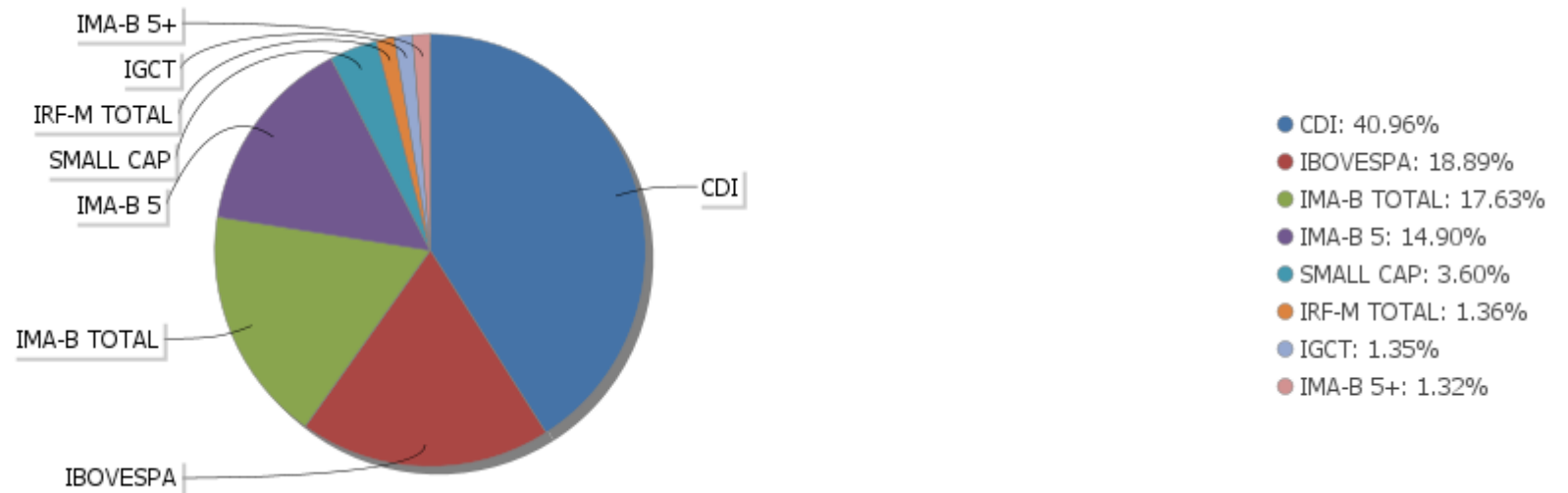


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

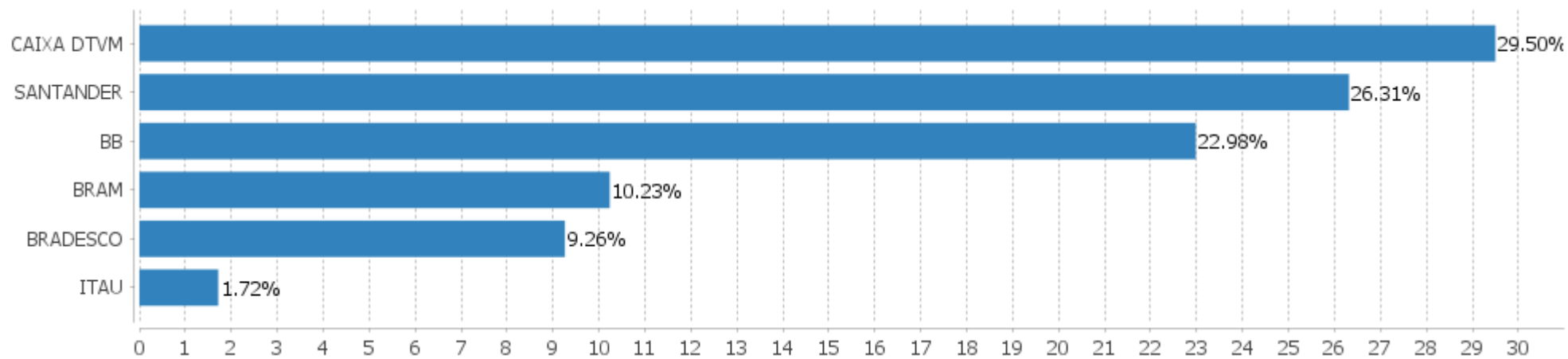


Alocação Por Estratégia



## 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 |
|----------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2024           | -0,84 | 0,77  | 0,34   | -0,81 |       |       |       |       |       |       |       |       | -0,55     |
| IPCA + 4,64%   | 0,82  | 1,18  | 0,52   | 0,78  |       |       |       |       |       |       |       |       | 3,33      |
| p.p. indexador | -1,66 | -0,41 | -0,18  | -1,59 |       |       |       |       |       |       |       |       | -3,88     |
| 2023           | 1,43  | -1,02 | 0,62   | 1,33  | 2,25  | 3,02  | 1,52  | -0,97 | 0,25  | -0,73 | 3,88  | 2,58  | 14,97     |
| IPCA + 4,64%   | 0,93  | 1,17  | 1,13   | 0,94  | 0,63  | 0,30  | 0,50  | 0,65  | 0,62  | 0,62  | 0,64  | 0,92  | 9,42      |
| p.p. indexador | 0,50  | -2,18 | -0,51  | 0,40  | 1,62  | 2,72  | 1,02  | -1,61 | -0,37 | -1,35 | 3,24  | 1,66  | 5,55      |
| 2022           | 1,34  | 0,49  | 3,60   | -1,67 | 1,24  | -3,06 | 0,86  | 2,25  | 0,72  | 2,59  | -1,71 | -0,39 | 6,24      |
| IPCA + 4,80%   | 0,93  | 1,37  | 2,04   | 1,42  | 0,88  | 1,06  | -0,29 | 0,07  | 0,10  | 0,96  | 0,78  | 1,03  | 10,84     |
| p.p. indexador | 0,41  | -0,88 | 1,57   | -3,09 | 0,36  | -4,12 | 1,16  | 2,18  | 0,62  | 1,62  | -2,49 | -1,42 | -4,60     |
| 2021           | -1,25 | -1,72 | 1,08   | 1,36  | 2,39  | 0,39  | -1,37 | -1,38 | -1,68 | -3,56 | 1,56  | 1,08  | -3,23     |
| IPCA + 5,42%   | 0,67  | 1,24  | 1,42   | 0,73  | 1,27  | 0,97  | 1,43  | 1,34  | 1,61  | 1,68  | 1,37  | 1,22  | 16,00     |
| p.p. indexador | -1,92 | -2,97 | -0,34  | 0,63  | 1,12  | -0,58 | -2,79 | -2,72 | -3,29 | -5,24 | 0,19  | -0,13 | -19,23    |
| 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

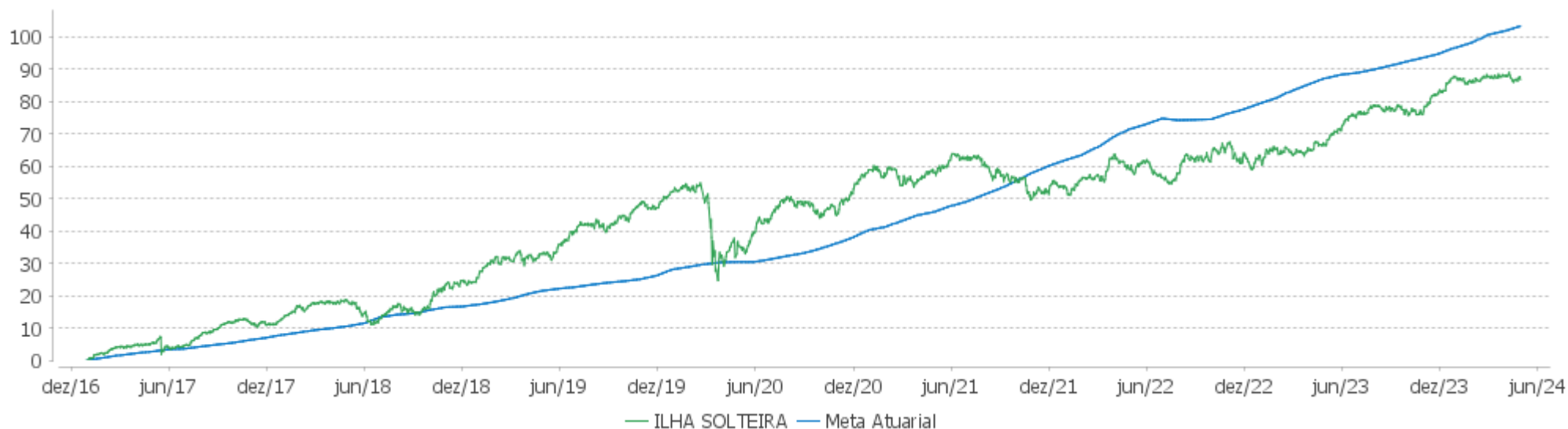
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período  | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|----------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 44         | 50,00     | 03 meses | 0,29     | 2,49          | -2,20      | 3,62               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 44         | 50,00     | 06 meses | 5,98     | 4,96          | 1,03       | 3,95               |
|                                 |            |           | 12 meses | 11,69    | 8,48          | 3,21       | 4,26               |
|                                 |            |           | 24 meses | 17,08    | 18,36         | -1,28      | 5,83               |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,90       | 2018-10   | 36 meses | 18,22    | 39,62         | -21,40     | 6,22               |
| Menor rentabilidade da Carteira | -11,70     | 2020-03   | 48 meses | 37,84    | 57,54         | -19,70     | 6,68               |
|                                 |            |           | 60 meses | 40,30    | 70,98         | -30,68     | 9,05               |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Desde 30/12/2016 | 86,69    | 113,23        | -26,54     | 8,36               |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

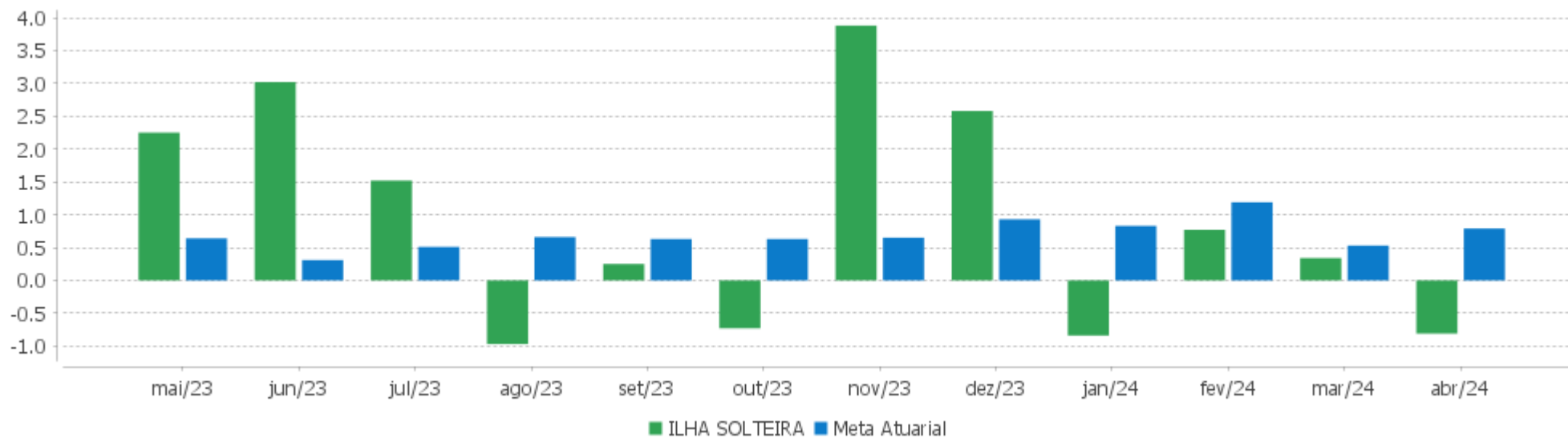


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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        |
|---|----------------|-----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | -1,64<br>-0,02 | -1,51<br>-0,07  | -1,05<br>-0,05 | 3,81<br>-0,11  | 7,65<br>-0,18   | 16,91<br>-0,38  | 22,07<br>-0,73  |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.              | -0,22<br>-0,02 | 1,77<br>-0,08   | 1,10<br>-0,06  | 5,07<br>-0,13  | 8,17<br>-0,25   | 18,39<br>-0,53  | 29,30<br>-0,85  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.   | -0,22<br>-0,02 | 1,78<br>-0,07   | 1,11<br>-0,05  | 5,09<br>-0,11  | 8,28<br>-0,15   | 18,63<br>-0,28  | 29,55<br>-0,60  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.                     | -0,22<br>-0,02 | 1,77<br>-0,08   | 1,10<br>-0,06  | 5,09<br>-0,11  | 8,23<br>-0,19   | 18,45<br>-0,46  | 29,22<br>-0,93  |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.         | -1,63<br>-0,02 | -1,53<br>-0,09  | -1,05<br>-0,05 | 3,81<br>-0,11  | 7,58<br>-0,24   | 16,76<br>-0,54  | 21,83<br>-0,97  |
| BB PREV RF IRF M<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.                             | -0,56<br>-0,03 | 1,04<br>-0,10   | 0,38<br>-0,09  | 5,04<br>-0,13  | 11,78<br>-0,42  | 25,85<br>-0,84  | 27,00<br>-1,22  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p. | -2,91<br>0,00  | -4,39<br>-0,01  | -2,97<br>-0,02 | 2,72<br>-0,05  | 6,67<br>-0,18   | 14,95<br>-0,58  | 14,36<br>-1,13  |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | -1,64<br>-0,02 | -1,53<br>-0,09  | -1,06<br>-0,07 | 3,79<br>-0,14  | 7,56<br>-0,26   | 16,71<br>-0,59  | 21,87<br>-0,92  |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM<br>% do CDI                    | 0,95<br>106,76 | 3,90<br>110,20  | 2,78<br>109,24 | 5,91<br>108,95 | 13,37<br>108,45 | 28,95<br>105,84 | 38,89<br>106,95 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                        | 0,88<br>99,61  | 3,55<br>100,49  | 2,56<br>100,68 | 5,44<br>100,38 | 12,40<br>100,56 | 27,42<br>100,27 | 36,85<br>101,33 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI             | 0,89<br>100,46 | 3,64<br>102,85  | 2,61<br>102,47 | 5,61<br>103,38 | 12,90<br>104,64 | 28,00<br>102,37 | 37,57<br>103,32 |
| SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI<br>% do CDI          | 0,94<br>106,12 | 3,76<br>106,34  | 2,69<br>105,78 | 5,73<br>105,59 | 13,16<br>106,73 | 28,31<br>103,52 | 38,26<br>105,22 |
| FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES<br>% do CDI   | 0,80<br>90,03  | 3,19<br>90,25   | 2,29<br>90,14  | 4,90<br>90,44  | 11,14<br>90,39  | 23,89<br>87,34  | 30,96<br>85,14  |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                           | -2,27<br>-0,57 | -7,60<br>-1,44  | -3,08<br>-1,65 | 8,03<br>-3,26  | 16,95<br>-3,64  | 11,98<br>-4,75  | -1,21<br>-7,12  |
| BRADESCO F I A SELECTION<br>Var. IBOVESPA p.p.                        | -6,73<br>-5,03 | -9,55<br>-3,39  | -5,50<br>-4,07 | 6,62<br>-4,67  | 10,25<br>-10,33 | 5,37<br>-11,36  | -8,05<br>-13,96 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO<br>Var. SMALL CAP p.p.                     | -7,83<br>-0,08 | -11,77<br>-0,24 | -5,54<br>-0,22 | 5,88<br>-0,64  | 11,15<br>-1,21  | -11,30<br>-1,32 | -30,27<br>-1,57 |
| FIA BRASIL IBX-50   | -1,42          | -5,50           | -1,39          | 11,15          | 17,99           | 8,11            | -1,40           |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                               | No Mês         | No Ano          | 3 meses        | 6 meses        | 12 meses       | 24 meses        | 36 meses         |
|---|----------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|------------------|
| Var. IBOVESPA p.p.  | 0,28           | 0,66            | 0,04           | -0,15          | -2,59          | -8,62           | -7,31            |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.      | -3,40<br>-1,69 | -8,92<br>-2,76  | -4,87<br>-3,44 | 6,30<br>-4,99  | 9,70<br>-10,88 | -0,70<br>-17,43 | -14,53<br>-20,45 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI<br>Var. IBOVESPA p.p. | -3,48<br>-1,78 | -7,63<br>-1,47  | -3,30<br>-1,87 | 8,50<br>-2,79  | 16,06<br>-4,52 | 13,08<br>-3,65  | -4,29<br>-10,20  |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI<br>Var. IGCT p.p.                      | -1,50<br>0,07  | -5,62<br>-0,18  | -1,11<br>-0,14 | 11,70<br>-0,51 | 20,72<br>-1,43 | 13,22<br>-2,89  | 0,21<br>-3,50    |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS<br>Var. IBOVESPA p.p.                     | -2,16<br>-0,46 | -6,28<br>-0,12  | -2,20<br>-0,77 | 10,23<br>-1,07 | 17,05<br>-3,53 | 12,20<br>-4,53  | 3,67<br>-2,24    |
| BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS<br>Var. SMALL CAP p.p.    | -7,91<br>-0,15 | -12,59<br>-1,06 | -6,12<br>-0,80 | 4,41<br>-2,10  | 1,37<br>-10,99 | -18,02<br>-8,04 | -27,97<br>0,74   |
| BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS<br>Var. IBOVESPA p.p.              | -1,74<br>-0,03 | -6,26<br>-0,10  | -1,50<br>-0,07 | 11,27<br>-0,03 | 20,56<br>-0,02 | 16,79<br>0,06   | 5,70<br>-0,21    |
| ILHA SOLTEIRA<br>Var. IPCA + 4,80% p.p.                       | -0,81<br>-1,59 | -0,55<br>-3,88  | 0,29<br>-2,20  | 5,98<br>1,03   | 11,69<br>3,21  | 17,08<br>-1,16  | 18,22<br>-20,49  |
| CDI   | 0,89           | 3,54            | 2,54           | 5,42           | 12,33          | 27,35           | 36,36            |
| IBOVESPA  | -1,70          | -6,16           | -1,43          | 11,30          | 20,58          | 16,73           | 5,91             |
| INPC + 6,00%  | 0,88           | 3,93            | 2,82           | 5,58           | 9,40           | 20,38           | 43,48            |
| IPCA + 6,00%  | 0,89           | 3,77            | 2,82           | 5,62           | 9,88           | 21,32           | 44,17            |



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo   | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas       |               |
|---|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
|   | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA                                   | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 1,00          |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                                     | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 2,00          |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                                  | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 1,00          |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                    | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |             | 0,20          |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                            | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |             | 0,20          |
| BB PREV RF IRF M  | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |             | 0,20          |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                      | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BRADESCO F I A SELECTION                                | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 1,50          |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS                     | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 1,50          |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM                  | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS                              | D+0       | D+0        | D+0       | D+2 du     |             | 0,50          |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP          | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP         | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP            | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP           | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FIA BRASIL IBX-50                                       | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 0,70          |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                              | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 1,50          |
| FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,80          |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI                 | D+1 du    | D+0        | D+2 du    | D+4 du     |             | 1,50          |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES                      | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 2,00          |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI                     | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |             | 0,10          |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR              | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |             | 0,20          |
| SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI        | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador       | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1         | 0,58   | 3,05   | 2,20    | 5,03    | 11,97    | 26,87    | 34,02    | 37,14    | 46,19    |
| IRF-M 1+        | -1,02  | 0,33   | -0,26   | 5,27    | 12,67    | 27,40    | 26,02    | 27,83    | 45,63    |
| IRF-M TOTAL     | -0,52  | 1,14   | 0,47    | 5,18    | 12,20    | 26,69    | 28,23    | 30,71    | 46,00    |
| IMA-B 5         | -0,20  | 1,85   | 1,16    | 5,20    | 8,42     | 18,91    | 30,15    | 41,76    | 54,05    |
| IMA-B 5+        | -2,91  | -4,38  | -2,95   | 2,77    | 6,84     | 15,52    | 15,49    | 27,38    | 38,18    |
| IMA-B TOTAL     | -1,61  | -1,44  | -1,00   | 3,93    | 7,83     | 17,30    | 22,80    | 34,66    | 46,69    |
| IMA-GERAL TOTAL | -0,22  | 1,41   | 0,94    | 4,96    | 10,96    | 23,84    | 29,96    | 35,96    | 47,48    |
| IDKA 2          | -0,29  | 1,94   | 1,12    | 5,32    | 8,39     | 18,52    | 29,51    | 41,70    | 53,91    |
| IDKA 20         | -4,90  | -9,27  | -6,13   | 1,23    | 7,00     | 14,11    | 3,87     | 18,01    | 24,63    |
| CDI             | 0,89   | 3,54   | 2,54    | 5,42    | 12,33    | 27,35    | 36,36    | 39,29    | 46,54    |

Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -1,70  | -6,16  | -1,43   | 11,30   | 20,58    | 16,73    | 5,91     | 56,42    | 30,69    |
| IBRX 100                 | -1,34  | -5,57  | -1,11   | 11,93   | 21,16    | 15,35    | 3,64     | 56,75    | 33,05    |
| IBRX 50                  | -0,62  | -4,66  | -0,53   | 12,46   | 22,10    | 17,11    | 6,05     | 62,71    | 32,79    |
| SMALL CAP                | -7,76  | -11,53 | -5,32   | 6,51    | 12,36    | -9,98    | -28,71   | 11,14    | 6,04     |
| Índice Consumo - ICON    | -5,98  | -12,66 | -4,71   | 7,68    | 6,01     | -22,89   | -46,53   | -30,89   | -30,19   |
| Índice Dividendos - IDIV | -0,56  | -4,35  | -0,87   | 13,19   | 21,76    | 24,83    | 29,53    | 77,48    | 64,74    |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500   | -0,79  | 12,78  | 8,50    | 22,79   | 24,91    | 28,13    | 15,27    | 64,77    | 124,09   |

**Investimentos Imobiliários**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | -0,77  | 2,12   | 1,45    | 7,16    | 18,32    | 20,22    | 18,20    | 29,89    | 34,82    |

**Investimentos no Exterior**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 0,00   | 11,18  | 8,09    | 21,53   | 19,47    | 21,69    | 3,18     | 47,40    | 88,97    |

**Indicadores Econômicos**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,38   | 1,80   | 1,38    | 2,66    | 3,69     | 8,03     | 21,13    | 29,32    | 32,42    |
| INPC      | 0,37   | 1,95   | 1,38    | 2,62    | 3,23     | 7,19     | 20,55    | 29,70    | 32,89    |
| IGPM      | 0,31   | -0,60  | -0,68   | 0,73    | -3,04    | -5,14    | 8,77     | 43,59    | 53,19    |
| SELIC     | 0,89   | 3,54   | 2,54    | 5,42    | 12,33    | 27,35    | 36,36    | 39,29    | 46,54    |

**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   | 3,12   | 2,34    | 4,64    | 7,82     | 16,81    | 36,19    | 51,17    | 61,01    |
| IPCA + 5,00% | 0,81   | 3,45   | 2,58    | 5,13    | 8,85     | 19,05    | 40,14    | 57,04    | 68,88    |
| IPCA + 5,50% | 0,85   | 3,61   | 2,70    | 5,38    | 9,37     | 20,19    | 42,15    | 60,03    | 72,92    |
| IPCA + 5,89% | 0,88   | 3,74   | 2,79    | 5,57    | 9,77     | 21,07    | 43,72    | 62,40    | 76,13    |
| IPCA + 6,00% | 0,89   | 3,77   | 2,82    | 5,62    | 9,88     | 21,32    | 44,17    | 63,07    | 77,05    |
| INPC + 4,00% | 0,71   | 3,28   | 2,34    | 4,60    | 7,35     | 15,90    | 35,54    | 51,62    | 61,59    |
| INPC + 6,00% | 0,88   | 3,93   | 2,82    | 5,58    | 9,40     | 20,38    | 43,48    | 63,56    | 77,68    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR          | Data       | Ativo  | Aplicação           | Resgate             | Quantidade       | Valor Cota     |
|--------------|------------|--|---------------------|---------------------|------------------|----------------|
| 378          | 01/04/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | 0,00                | 460.000,00          | 146.246,29659152 | 3,1453787940   |
| 382          | 01/04/2024 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,00                | 200.000,00          | 38.974,91301774  | 5,1315060000   |
| 384          | 01/04/2024 | SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI | 0,00                | 810.000,00          | 3.136,95248486   | 258,2123905000 |
| 383          | 05/04/2024 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,00                | 70.000,00           | 13.618,96055035  | 5,1398930000   |
| 379          | 10/04/2024 | BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM            | 1.400.000,00        | 0,00                | 81.878,82042190  | 17,0984388000  |
| 380          | 29/04/2024 | BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM            | 0,00                | 677.072,99          | 39.385,57208281  | 17,1908888000  |
| 381          | 29/04/2024 | BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM            | 0,00                | 42.927,01           | 2.497,07915044   | 17,1908888000  |
| <b>Total</b> |            |  | <b>1.400.000,00</b> | <b>2.260.000,00</b> |                  |                |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.518.634,98

Value-At-Risk: 1,71%

|               | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|---------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º     | 1,29                        | 0,43               |                       | 0,23                | -0,69  | 0,00  | 156.756.669,75 | 76,16      |
| Artigo 8º     | 13,75                       | 6,28               |                       | 1,48                | -0,30  | -3,30 | 49.063.593,13  | 23,84      |
| ILHA SOLTEIRA |                             | 1,71               |                       | 1,71                |        |       | 205.820.262,88 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,43%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 3,47                        | 1,24               | 0,03                | 0,02                | -0,73  | -1,63 | 6.319.969,63  | 3,07       |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                    | 1,93                        | 0,53               | 0,01                | 0,01                | -0,57  | -0,22 | 7.225.842,84  | 3,51       |
| BB PREV RF IRF M                                | 3,01                        | 0,92               | 0,01                | 0,01                | -0,48  | -0,56 | 2.797.347,16  | 1,36       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP  | 1,94                        | 0,53               | 0,01                | 0,01                | -0,57  | -0,22 | 7.283.655,50  | 3,54       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,22                        | 1,95               | 0,02                | 0,03                | -0,73  | -2,91 | 2.707.653,44  | 1,32       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 3,47                        | 1,23               | 0,03                | 0,01                | -0,73  | -1,64 | 6.310.878,96  | 3,07       |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI             | 1,93                        | 0,53               | 0,03                | 0,00                | -0,57  | -0,22 | 16.153.144,73 | 7,85       |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR      | 3,47                        | 1,24               | 0,10                | 0,01                | -0,73  | -1,64 | 23.649.128,41 | 11,49      |
| <b>Sub-total</b>                                | 2,75                        | 0,92               | 0,23                |                     | -0,70  | -1,05 | 72.447.620,67 | 35,20      |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe  | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|---------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                      | 0,03                        | 0,02               | 0,00                | 0,01                | -0,13   | 0,88  | 20.153.127,03 | 9,79       |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM                  | 0,10                        | 0,07               | -0,00               | 0,07                | 0,60    | 0,95  | 19.050.623,76 | 9,26       |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP           | 0,04                        | 0,02               | 0,00                | 0,02                | 0,12    | 0,89  | 31.617.878,63 | 15,36      |
| FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES | 0,00                        | 0,01               | 0,00                | 0,00                | -124,76 | 0,80  | 129.586,58    | 0,06       |
| SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI        | 0,09                        | 0,03               | 0,00                | 0,03                | 0,61    | 0,94  | 13.357.833,08 | 6,49       |
| <b>Sub-total</b>  | 0,03                        | 0,02               | 0,00                |                     | 0,86    | 0,91  | 84.309.049,08 | 40,96      |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,28%

Artigo 8º I

| Ativo                                   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe       | Rent.        | Valor(R\$)           | % Carteira   |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA                   | 13,76                       | 6,57               | 0,13                | 1,51                | -0,23        | -2,27        | 4.275.310,32         | 2,08         |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                     | 12,83                       | 6,26               | 0,11                | 1,71                | -0,24        | -2,16        | 3.752.474,17         | 1,82         |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                  | 13,05                       | 6,21               | 0,08                | 0,18                | -0,18        | -1,50        | 2.778.119,90         | 1,35         |
| BRADESCO F I A SELECTION                | 16,71                       | 6,43               | 0,12                | 2,26                | -0,46        | -6,73        | 4.102.911,00         | 1,99         |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS     | 18,20                       | 8,55               | 0,18                | 2,58                | -0,48        | -7,91        | 4.729.180,67         | 2,30         |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS              | 12,79                       | 6,05               | 0,35                | 0,04                | -0,21        | -1,74        | 12.230.078,59        | 5,94         |
| FIA BRASIL IBX-50                       | 12,40                       | 5,96               | 0,28                | 0,69                | -0,19        | -1,42        | 9.994.195,99         | 4,86         |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO              | 19,89                       | 8,38               | 0,10                | 0,09                | -0,44        | -7,83        | 2.671.124,75         | 1,30         |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 13,06                       | 6,00               | 0,10                | 1,29                | -0,33        | -3,48        | 3.531.277,22         | 1,72         |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES      | 12,39                       | 5,68               | 0,03                | 1,16                | -0,35        | -3,40        | 998.920,52           | 0,49         |
| <b>Sub-total</b>                        | <b>13,75</b>                | <b>6,28</b>        | <b>1,48</b>         |                     | <b>-0,30</b> | <b>-3,30</b> | <b>49.063.593,13</b> | <b>23,84</b> |

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)