



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
OUTUBRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

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

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

74,75%

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 | 3,34 | -2,68 | -5,78 | 1.800.416,65 | 1,02 | 4.936.979.120,19 | 0,04 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 5,61 | -2,58 | -4,98 | 15.155.482,34 | 8,63 | 6.948.438.281,62 | 0,22 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,59 | -2,56 | -5,00 | 12.705.191,74 | 7,23 | 4.811.776.336,97 | 0,26 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,69 | -1,24 | 1,03 | 8.212.244,56 | 4,67 | 10.998.044.937,35 | 0,07 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 2,68 | -1,25 | 1,05 | 12.540.669,88 | 7,14 | 1.192.878.203,57 | 1,05 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR | 5,59 | -2,56 | -5,00 | 18.860.895,59 | 10,73 | 1.083.533.278,18 | 1,74 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 8,66 | -3,98 | -10,58 | 9.497.569,15 | 5,41 | 1.296.457.169,22 | 0,73 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2,70 | -1,27 | 0,98 | 11.999.500,20 | 6,83 | 6.081.334.244,20 | 0,20 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 4,72 | -2,25 | -3,57 | 90.771.970,11 | 51,66 | | |

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 | 0,19 | 0,58 | 3,44 | 245.854,85 | 0,14 | 3.647.662.584,07 | 0,01 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,19 | 0,50 | 3,17 | 12.851.293,23 | 7,31 | 7.402.600.316,43 | 0,17 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 5,80 | -2,65 | -5,71 | 7.832.535,52 | 4,46 | 996.657.609,56 | 0,79 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,11 | 0,49 | 3,14 | 630.073,20 | 0,36 | 6.213.259.499,94 | 0,01 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | 8,66 | -3,97 | -10,45 | 4.235.746,24 | 2,41 | 184.865.255,88 | 2,29 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,08 | 0,38 | 2,16 | 100.664,06 | 0,06 | 615.231.424,98 | 0,02 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 2,84 | -1,28 | 0,39 | 12.825.057,83 | 7,30 | 1.191.680.411,60 | 1,08 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF ATIVO FIC | 0,85 | -0,55 | 1,08 | 1.857.092,82 | 1,06 | 777.995.461,61 | 0,24 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 2,83 | -1,16 | -0,94 | 40.578.317,75 | 23,09 | | |
| Renda Fixa | | | 4,13 | -1,91 | -2,75 | 131.350.287,86 | 74,75 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,25%

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 | 20,95 | -6,77 | -13,30 | 10.050.978,91 | 5,72 | 258.245.548,69 | 3,89 |
| CEF | CEF | FIA BRASIL IBX-50 | 21,00 | -6,64 | -12,29 | 8.667.571,66 | 4,93 | 1.058.843.792,37 | 0,82 |
| BB | BB | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 20,47 | -7,87 | -12,93 | 2.352.628,84 | 1,34 | 1.033.151.119,42 | 0,23 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 20,85 | -6,84 | -12,80 | 21.071.179,41 | 11,99 | | |

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 | 20,63 | -8,53 | -18,93 | 989.652,26 | 0,56 | 219.426.925,85 | 0,45 |
| BRAM | BEM | BRDESCO F I A SELECTION | 21,09 | -8,62 | -17,61 | 3.762.300,93 | 2,14 | 548.943.483,80 | 0,69 |
| BB | BB | BB AÇÕES DIVIDENDOS | 19,27 | -4,81 | -15,21 | 3.101.476,97 | 1,77 | 702.110.244,75 | 0,44 |
| BRAM | BEM | BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 21,12 | -12,54 | -10,38 | 5.662.863,94 | 3,22 | 1.715.756.643,77 | 0,33 |
| ITAU | ITAU | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 19,94 | -8,78 | -16,45 | 3.072.629,39 | 1,75 | 778.358.877,30 | 0,39 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 23,33 | -12,37 | -17,84 | 3.043.826,36 | 1,73 | 900.555.238,47 | 0,34 |
| BB | BB | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 19,78 | -6,71 | -14,36 | 3.654.684,94 | 2,08 | 430.116.575,99 | 0,85 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 19,88 | -9,36 | -15,08 | 23.287.434,79 | 13,25 | | |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

20,11 -8,18 -14,01 44.358.614,20 25,25

Total

7,36 -3,56 -5,74 175.708.902,06 100,00

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 | 90.771.970,11 | 51,66 | 20,00 | 30,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 40.578.317,75 | 23,09 | 0,00 | 30,00 | 40,00 | 0,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 131.350.287,86 | 74,75 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 21.071.179,41 | 11,99 | 0,00 | 20,00 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 23.287.434,79 | 13,25 | 0,00 | 10,00 | 20,00 | 0,00 | 20,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 44.358.614,20 | 25,25 | | | | | 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 | -2,25 -469,06 | -3,57 -118,95 | -2,93 -217,11 | -2,08 -90,77 | 2,09 62,80 | -2.092.563,87 | -3.350.597,98 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | -1,16 -241,98 | -0,94 -31,47 | -1,13 -83,86 | -0,25 -10,85 | 2,54 76,58 | -495.894,48 | -429.986,81 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -6,84 -0,10 | -12,80 0,23 | -16,06 -1,03 | -13,93 -0,99 | 10,13 -0,03 | -1.547.498,20 | -2.961.975,24 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -9,36 -2,62 | -15,08 -2,04 | -17,79 -2,77 | -15,83 -2,89 | 3,02 -7,15 | -2.403.897,26 | -4.082.449,64 |
| ILHA SOLTEIRA (Total) | | | | | | -6.539.853,81 | -10.825.009,67 |

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 | 12.154.440,22 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.999.500,20 | -154.940,02 | 116.739,32 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 15.557.201,35 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.155.482,34 | -401.719,01 | -794.881,69 |
| BB PREV RF IRF-M | 1.849.957,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.800.416,65 | -49.540,40 | -99.834,56 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 9.891.258,97 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.497.569,15 | -393.689,82 | -1.123.281,58 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 8.315.695,25 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.212.244,56 | -103.450,69 | 83.332,56 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 13.039.209,15 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.705.191,74 | -334.017,41 | -669.146,30 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 12.699.411,34 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.540.669,88 | -158.741,46 | 129.926,16 |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR | 19.357.360,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 18.860.895,59 | -496.465,06 | -993.451,89 |
| | | | | | 90.771.970,11 | 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 | 846.148,15 | 0,00 | -220.000,00 | 0,00 | 630.073,20 | 3.925,05 | 45.748,42 |
| BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 791.416,22 | 0,00 | -550.000,00 | 0,00 | 245.854,85 | 4.438,63 | 71.008,21 |
| BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 12.991.806,34 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.825.057,83 | -166.748,51 | 49.642,12 |

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 | 8.045.734,83 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.832.535,52 | -213.199,31 | -473.907,05 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | 4.410.844,77 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.235.746,24 | -175.098,53 | -494.466,66 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 100.285,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 100.664,06 | 378,10 | 2.126,38 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 12.986.384,17 | 0,00 | -200.000,00 | 0,00 | 12.851.293,23 | 64.909,06 | 375.022,03 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC | 1.121.591,79 | 1.150.000,00 | -400.000,00 | 0,00 | 1.857.092,82 | -14.498,97 | -5.190,58 |
| | | | | | 40.578.317,75 | 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 | 2.553.547,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.352.628,84 | -200.918,82 | -329.817,52 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | 10.780.967,69 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.050.978,91 | -729.988,78 | -1.542.263,00 |
| FIA BRASIL IBX-50 | 9.284.162,26 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.667.571,66 | -616.590,60 | -1.089.894,72 |
| | | | | | 21.071.179,41 | 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 | 3.917.487,08 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.654.684,94 | -262.802,14 | -589.340,19 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | 3.258.358,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.101.476,97 | -156.881,77 | -536.057,19 |
| BRADESCO F I A SELECTION | 4.117.067,38 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.762.300,93 | -354.766,45 | -804.271,32 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 6.474.531,41 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.662.863,94 | -811.667,47 | -655.756,78 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 3.473.463,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.043.826,36 | -429.636,64 | -660.832,18 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 3.368.519,76 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.072.629,39 | -295.890,37 | -605.139,07 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | 1.081.904,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 989.652,26 | -92.252,42 | -231.052,91 |
| | | | | | 23.287.434,79 | 0,00 | 0,00 |

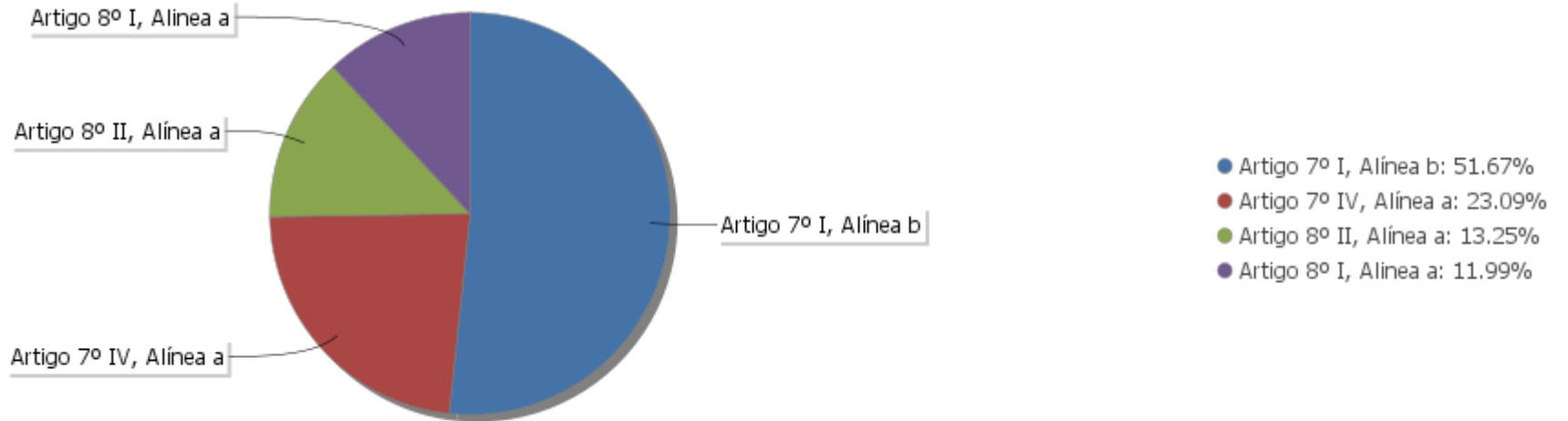
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

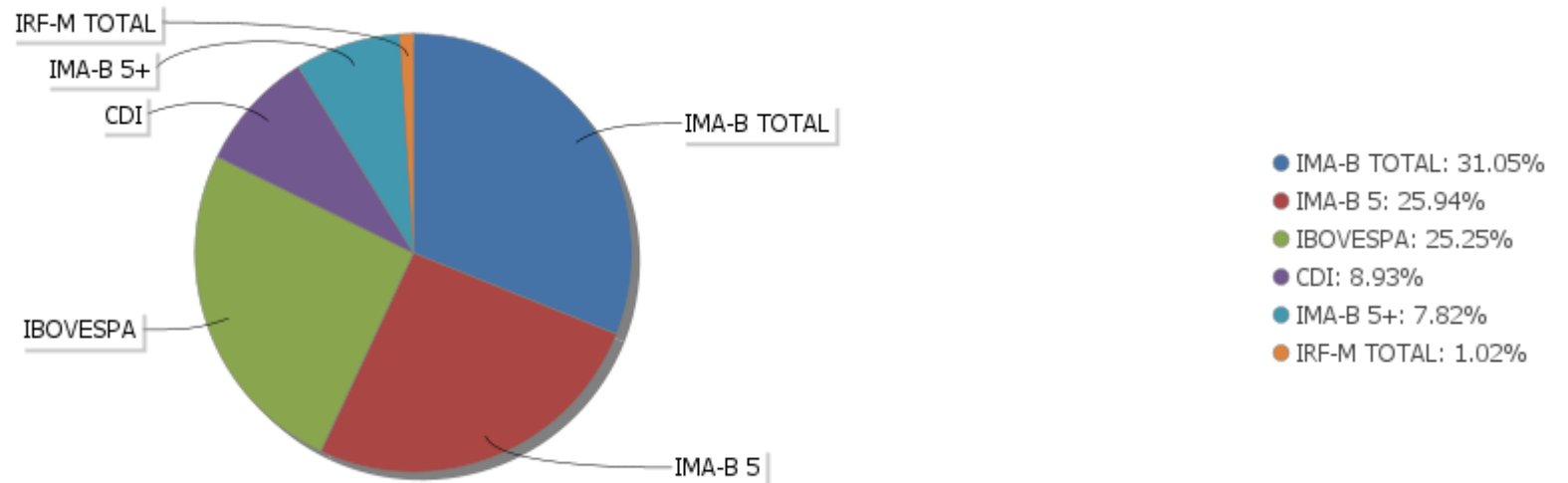
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 175.708.902,06 | 100,00 | 175.708.902,06 | 100,00 |
| de 31 a 365 dias | 0,00 | 0,00 | 175.708.902,06 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 175.708.902,06 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

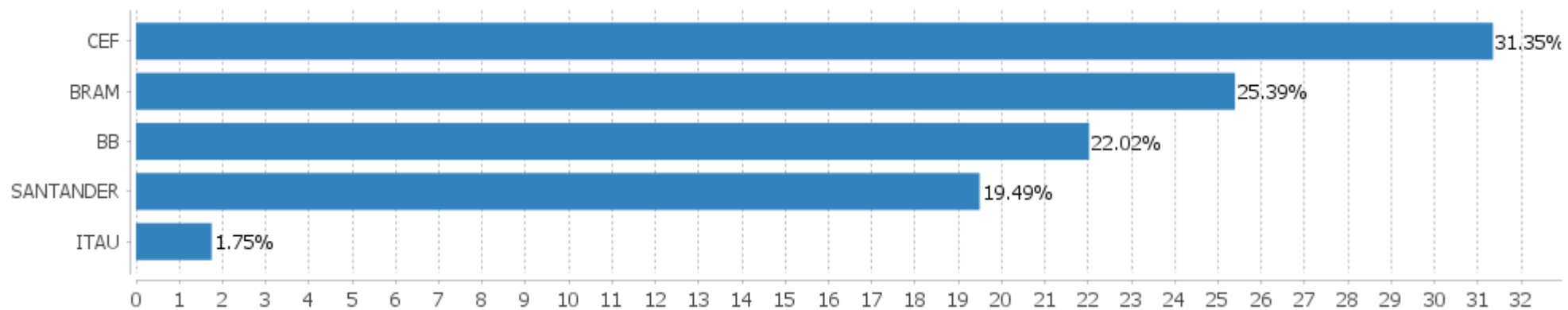


Alocação Por Estratégia



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 | 0,39 | -1,37 | -1,38 | -1,68 | -3,56 | | | -5,74 |
| IPCA + 5,42% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,27 | 0,97 | 1,43 | 1,34 | 1,61 | 1,68 | | | 13,05 |
| p.p. indexador | -1,92 | -2,97 | -0,34 | 0,63 | 1,12 | -0,58 | -2,79 | -2,72 | -3,29 | -5,24 | | | -18,80 |
| 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

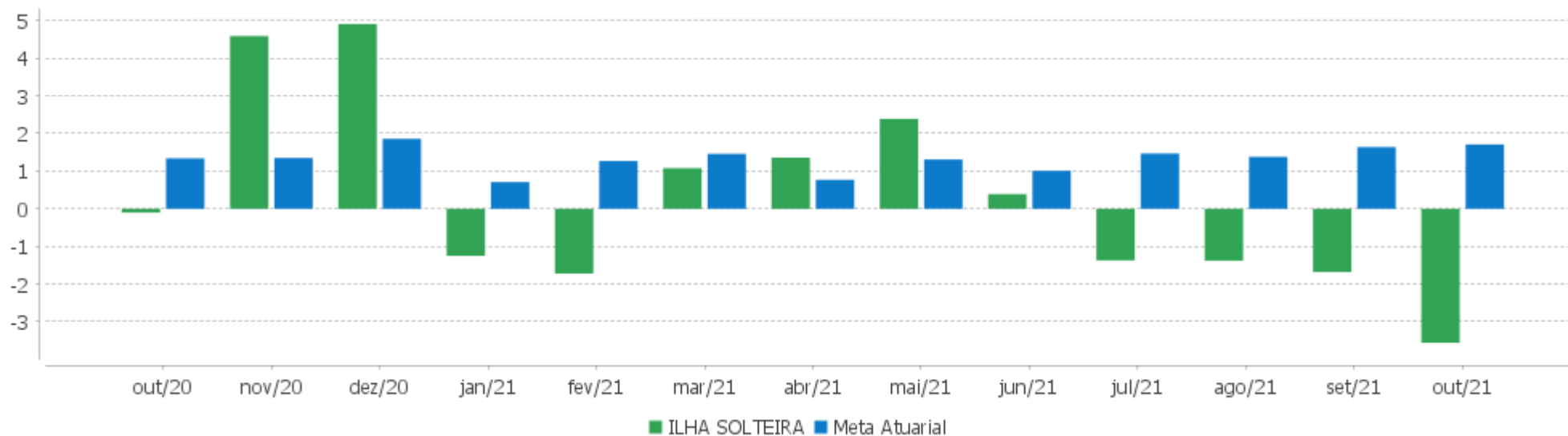
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 29 | 50,00 | 03 meses | -6,50 | 4,69 | -11,19 | 8,31 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 29 | 50,00 | 06 meses | -5,20 | 8,58 | -13,78 | 7,29 |
| | | | 12 meses | 3,43 | 16,71 | -13,28 | 7,36 |
| | | | 24 meses | 1,01 | 28,39 | -27,38 | 12,28 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,90 | 2018-10 | 36 meses | 21,54 | 39,54 | -18,00 | 10,73 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -11,70 | 2020-03 | 48 meses | 34,03 | 54,58 | -20,56 | 9,86 |
| | | | Desde 30/12/2016 | 49,71 | 65,82 | -16,12 | 9,36 |

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 |
|---|------------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p. | -2,65 -0,11 | -5,71 -0,92 | -3,98 -0,24 | -3,03 -0,35 | 0,95 -0,89 | -0,37 -1,18 | 26,43 -1,33 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI | -0,55 -113,86 | 1,08 35,94 | -0,02 -1,23 | 0,90 39,26 | 1,84 55,23 | 4,42 66,44 | 20,18 152,00 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p. | -1,28 -0,05 | 0,39 -0,83 | -0,27 -0,17 | 0,17 -0,32 | 3,50 -0,93 | 9,18 -1,21 | 24,12 -1,49 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI | 0,58 120,68 | 3,44 114,61 | 1,57 116,39 | 2,63 114,55 | 3,70 111,41 | 6,38 95,92 | 12,89 97,08 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,49 101,77 | 3,14 104,82 | 1,40 103,92 | 2,43 105,81 | 3,57 107,34 | 6,36 95,52 | 12,75 96,06 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,50 104,67 | 3,17 105,67 | 1,53 113,52 | 2,55 111,29 | 3,70 111,46 | 6,36 95,60 | 12,78 96,27 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p. | -3,97 -0,10 | -10,45 -0,20 | -7,45 -0,25 | -6,21 -0,36 | -1,37 -0,36 | -7,93 -1,12 | 25,72 -1,96 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI | 0,38 78,48 | 2,16 71,94 | 1,03 76,63 | 1,73 75,51 | 2,33 70,23 | 4,75 71,33 | 10,32 77,70 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | -2,56 -0,02 | -5,00 -0,22 | -3,82 -0,09 | -2,82 -0,14 | 1,58 -0,26 | 0,15 -0,66 | 26,66 -1,11 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | -1,25 -0,01 | 1,05 -0,17 | -0,15 -0,05 | 0,38 -0,11 | 4,21 -0,22 | 9,95 -0,44 | 24,83 -0,78 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | -1,24 -0,01 | 1,03 -0,19 | -0,14 -0,05 | 0,39 -0,10 | 4,19 -0,24 | 9,79 -0,60 | 24,71 -0,90 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | -1,27 -0,04 | 0,98 -0,24 | -0,21 -0,11 | 0,31 -0,18 | 4,16 -0,27 | 9,80 -0,59 | 24,69 -0,92 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | -2,58 -0,04 | -4,98 -0,20 | -3,83 -0,10 | -2,83 -0,15 | 1,60 -0,23 | 0,29 -0,52 | 26,82 -0,94 |
| BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p. | -2,68 -0,05 | -5,78 -0,28 | -3,67 -0,14 | -3,83 -0,24 | -3,60 -0,30 | 0,38 -0,61 | 14,87 -0,95 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | -3,98 -0,11 | -10,58 -0,33 | -7,43 -0,24 | -6,14 -0,29 | -1,35 -0,33 | -7,51 -0,70 | 26,13 -1,54 |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p. | -2,56 -0,02 | -5,00 -0,22 | -3,80 -0,06 | -2,80 -0,13 | 1,55 -0,28 | 0,01 -0,80 | 26,44 -1,33 |
| FIA BRASIL IBX-50 | -6,64 | -12,29 | -16,92 | -14,48 | 10,67 | -3,67 | 14,69 |

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. | 0,10 | 0,75 | -1,89 | -1,54 | 0,51 | -0,20 | -3,70 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | -7,87 | -12,93 | -16,80 | -15,14 | 9,20 | -3,27 | 21,36 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,13 | 0,10 | -1,77 | -2,19 | -0,96 | 0,20 | 2,97 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | -6,77 | -13,30 | -15,12 | -13,13 | 9,79 | -4,03 | 17,48 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,03 | -0,27 | -0,10 | -0,19 | -0,37 | -0,57 | -0,91 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | -6,71 | -14,36 | -16,18 | -15,55 | 8,19 | -8,26 | 10,77 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,03 | -1,32 | -1,16 | -2,60 | -1,97 | -4,79 | -7,62 |
| BRADESCO FIA SELECTION | -8,62 | -17,61 | -18,09 | -15,68 | -3,81 | -16,16 | 2,60 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,88 | -4,57 | -3,06 | -2,74 | -13,98 | -12,69 | -15,79 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | -12,37 | -17,84 | -22,19 | -20,54 | 2,31 | -6,25 | 29,49 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -5,63 | -4,80 | -7,17 | -7,60 | -7,85 | -2,78 | 11,10 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | -8,53 | -18,93 | -17,58 | -15,33 | -1,71 | -16,77 | 3,85 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,79 | -5,89 | -2,55 | -2,38 | -11,88 | -13,30 | -14,54 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | -8,78 | -16,45 | -17,48 | -16,72 | 2,98 | -6,40 | 18,83 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -2,05 | -3,42 | -2,45 | -3,77 | -7,18 | -2,93 | 0,44 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | -4,81 | -15,21 | -14,06 | -14,31 | 3,72 | -15,44 | 6,24 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,92 | -2,17 | 0,96 | -1,37 | -6,44 | -11,97 | -12,15 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | -12,54 | -10,38 | -18,27 | -13,75 | 5,56 | -0,00 | 37,64 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -5,80 | 2,66 | -3,25 | -0,80 | -4,60 | 3,47 | 19,25 |
| ILHA SOLTEIRA | -3,56 | -5,74 | -6,50 | -5,20 | 3,43 | 1,01 | 21,54 |
| Var. IPCA + 5,89% p.p. | -5,28 | -19,21 | -11,30 | -14,03 | -13,71 | -27,83 | -18,34 |
| CDI | 0,48 | 3,00 | 1,35 | 2,29 | 3,32 | 6,65 | 13,28 |
| IBOVESPA | -6,74 | -13,04 | -15,02 | -12,95 | 10,16 | -3,47 | 18,39 |
| INPC + 6,00% | 1,63 | 13,79 | 4,79 | 9,12 | 17,69 | 30,64 | 42,02 |
| IPCA + 6,00% | 1,72 | 13,57 | 4,83 | 8,88 | 17,26 | 29,10 | 40,32 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|----------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | -0,54 | 1,23 | 0,23 | 0,83 | 1,78 | 5,91 | 13,47 | 21,48 | 36,42 |
| IRF-M 1+ | -3,44 | -9,10 | -5,21 | -5,61 | -5,90 | -1,54 | 16,13 | 28,17 | 50,67 |
| IRF-M TOTAL | -2,63 | -5,50 | -3,53 | -3,59 | -3,30 | 0,99 | 15,83 | 26,75 | 47,22 |
| IMA-B 5 | -1,24 | 1,22 | -0,10 | 0,49 | 4,43 | 10,39 | 25,61 | 37,29 | 55,80 |
| IMA-B 5+ | -3,87 | -10,25 | -7,19 | -5,85 | -1,01 | -6,80 | 27,68 | 41,57 | 63,18 |
| IMA-B TOTAL | -2,54 | -4,79 | -3,73 | -2,67 | 1,83 | 0,81 | 27,76 | 40,92 | 61,47 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | -1,35 | -2,10 | -1,67 | -0,96 | 0,67 | 2,85 | 17,88 | 28,05 | 46,14 |
| IMA-GERAL TOTAL | -1,31 | -1,68 | -1,71 | -0,86 | 1,05 | 3,75 | 19,11 | 29,71 | 47,78 |
| IDKA 2 | -1,47 | 1,56 | -0,12 | 0,25 | 4,62 | 11,66 | 25,12 | 37,32 | 56,68 |
| IDKA 20 | -6,31 | -17,52 | -13,17 | -11,45 | -5,06 | -17,66 | 27,75 | 43,34 | 67,23 |
| CDI | 0,48 | 3,00 | 1,35 | 2,29 | 3,32 | 6,65 | 13,28 | 20,70 | 34,10 |

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 1,25 | 8,24 | 3,32 | 5,73 | 10,67 | 15,01 | 17,92 | 23,30 | 26,63 |
| INPC | 1,16 | 8,45 | 3,27 | 5,96 | 11,08 | 16,38 | 19,35 | 24,13 | 26,41 |
| IGPM | 0,64 | 16,74 | 0,66 | 6,24 | 21,73 | 47,21 | 51,84 | 68,23 | 65,87 |
| SELIC | 0,48 | 3,00 | 1,35 | 2,29 | 3,32 | 6,65 | 13,28 | 20,71 | 34,13 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | 10,92 | 33,14 | 15,45 | 15,03 | 37,70 | 113,67 | 157,78 | 207,96 | 284,24 |
| MSCI ACWI | 8,97 | 25,22 | 13,38 | 10,89 | 32,23 | 96,53 | 133,44 | 158,41 | 221,64 |
| MSCI World | 9,54 | 28,15 | 13,97 | 12,82 | 35,37 | 100,32 | 138,32 | 168,41 | 233,05 |

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

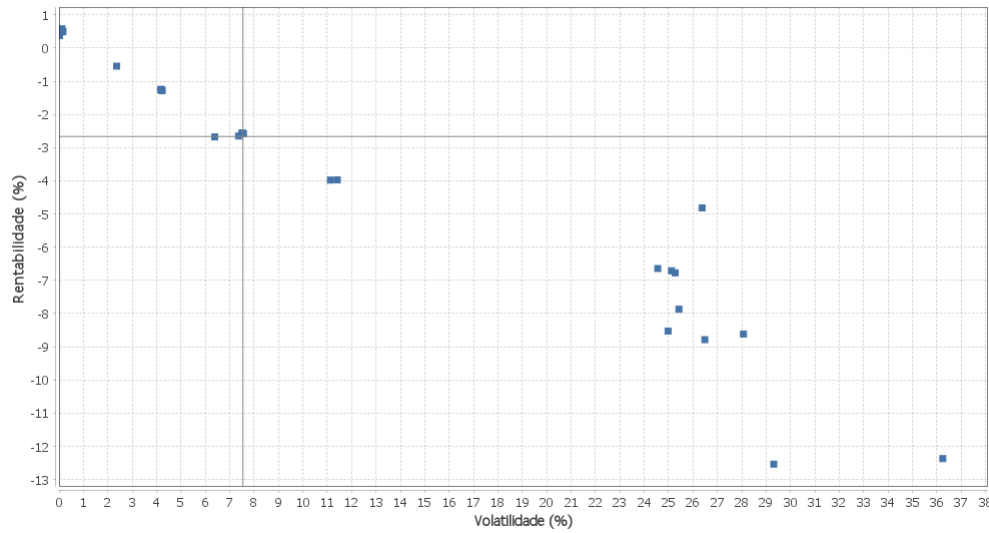
Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|--------------|------------|-----------------|---------------|
| 89 | 05/10/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 30.000,00 | 7.808,34562400 | 3,8420430000 |
| 90 | 08/10/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 70.000,00 | 18.204,37725900 | 3,8452290000 |
| 87 | 18/10/2021 | SANTANDER RF ATIVO FIC | 1.150.000,00 | 0,00 | 88.098,33410500 | 13,0535953000 |
| 88 | 25/10/2021 | SANTANDER RF ATIVO FIC | 0,00 | 400.000,00 | 30.846,98724500 | 12,9672307000 |
| 92 | 25/10/2021 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 220.000,00 | 92.754,19812300 | 2,3718602980 |
| 86 | 28/10/2021 | BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 550.000,00 | 43.292,78100000 | 12,7041966000 |
| 91 | 28/10/2021 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 100.000,00 | 25.929,64926900 | 3,8565890000 |
| Total | | | | | | |

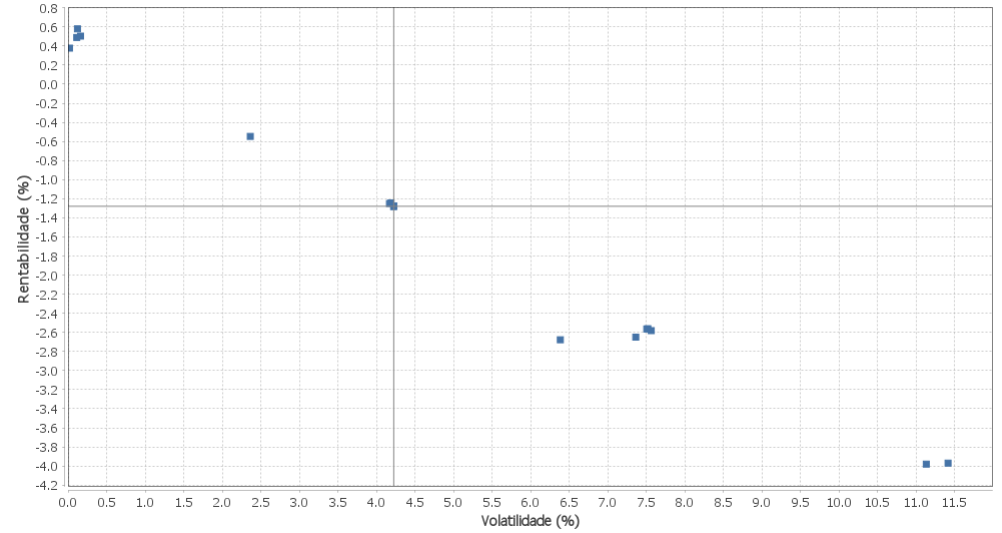
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

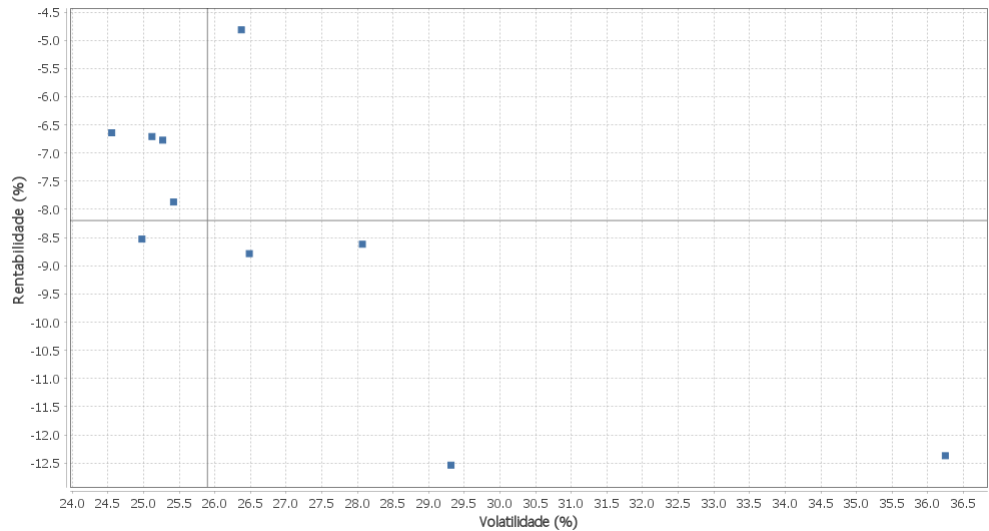
ILHA SOLTEIRA - No Mês



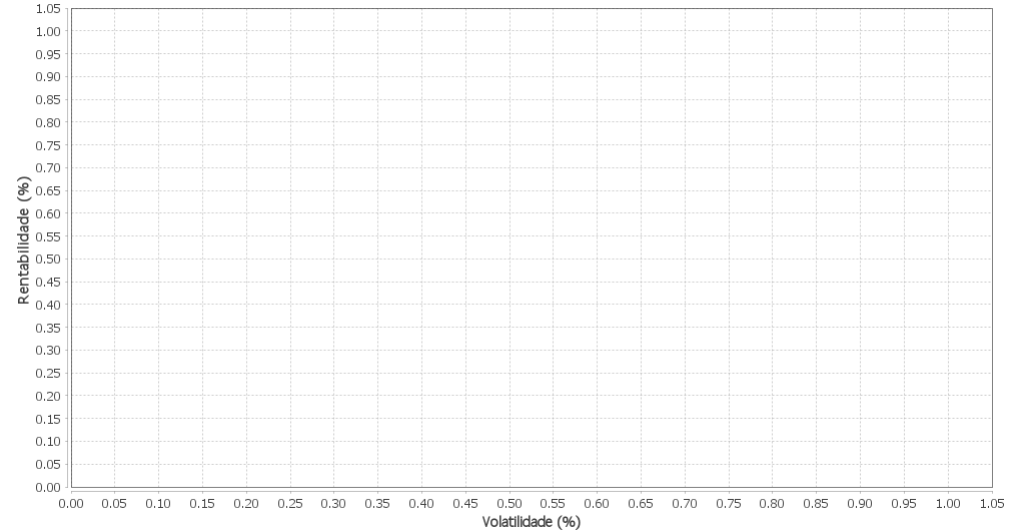
Renda Fixa - No Mês



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\$): 6.306.944,70

Value-At-Risk: 3,59%

| 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 | -5,57 | 0,38 | 100.664,06 | 0,06 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,11 | 0,05 | 0,00 | 0,08 | 0,49 | 630.073,20 | 0,36 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,12 | 0,05 | -0,00 | 0,81 | 0,58 | 245.854,85 | 0,14 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,16 | 0,06 | 0,00 | 0,14 | 0,50 | 12.851.293,23 | 7,31 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC | Artigo 7º IV, Alínea a | 2,36 | 0,42 | 0,00 | -0,43 | -0,55 | 1.857.092,82 | 1,06 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 4,17 | 1,43 | 0,06 | -0,42 | -1,25 | 12.540.669,88 | 7,14 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 4,19 | 1,44 | 0,04 | -0,41 | -1,24 | 8.212.244,56 | 4,67 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | Artigo 7º IV, Alínea a | 4,22 | 1,51 | 0,07 | -0,42 | -1,28 | 12.825.057,83 | 7,30 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 4,22 | 1,44 | 0,06 | -0,42 | -1,27 | 11.999.500,20 | 6,83 |
| BB PREV RF IRF-M | Artigo 7º I, Alínea b | 6,38 | 1,75 | 0,01 | -0,49 | -2,68 | 1.800.416,65 | 1,02 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | Artigo 7º IV, Alínea a | 7,36 | 2,82 | 0,09 | -0,43 | -2,65 | 7.832.535,52 | 4,46 |
| SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR | Artigo 7º I, Alínea b | 7,50 | 2,75 | 0,22 | -0,41 | -2,56 | 18.860.895,59 | 10,73 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 7,52 | 2,75 | 0,14 | -0,40 | -2,56 | 12.705.191,74 | 7,23 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 7,56 | 2,76 | 0,17 | -0,40 | -2,58 | 15.155.482,34 | 8,63 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 11,13 | 3,75 | 0,15 | -0,40 | -3,98 | 9.497.569,15 | 5,41 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | Artigo 7º IV, Alínea a | 11,41 | 3,73 | 0,07 | -0,39 | -3,97 | 4.235.746,24 | 2,41 |
| FIA BRASIL IBX-50 | Artigo 8º I, Alínea a | 24,55 | 10,66 | 0,47 | -0,29 | -6,64 | 8.667.571,66 | 4,93 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | Artigo 8º II, Alínea a | 24,98 | 9,41 | 0,05 | -0,36 | -8,53 | 989.652,26 | 0,56 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 25,12 | 10,19 | 0,19 | -0,29 | -6,71 | 3.654.684,94 | 2,08 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | Artigo 8º I, Alínea a | 25,27 | 9,86 | 0,51 | -0,29 | -6,77 | 10.050.978,91 | 5,72 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | Artigo 8º I, Alínea a | 25,42 | 10,37 | 0,13 | -0,33 | -7,87 | 2.352.628,84 | 1,34 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 26,37 | 9,90 | 0,16 | -0,20 | -4,81 | 3.101.476,97 | 1,77 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | Artigo 8º II, Alínea a | 26,48 | 10,60 | 0,17 | -0,35 | -8,78 | 3.072.629,39 | 1,75 |
| BRADESCO F I A SELECTION | Artigo 8º II, Alínea a | 28,07 | 11,47 | 0,22 | -0,32 | -8,62 | 3.762.300,93 | 2,14 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | Artigo 8º II, Alínea a | 29,31 | 12,56 | 0,36 | -0,44 | -12,54 | 5.662.863,94 | 3,22 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 36,25 | 14,94 | 0,23 | -0,35 | -12,37 | 3.043.826,36 | 1,73 |