



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
JANEIRO 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

71,57%

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-----------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M | 2,06 | 0,85 | 0,85 | 1.294.022,54 | 0,69 | 5.205.249.143,09 | 0,02 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 4,90 | 0,26 | 0,26 | 15.066.683,73 | 8,03 | 6.477.324.446,92 | 0,23 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,91 | 0,25 | 0,25 | 12.641.043,56 | 6,74 | 6.604.088.892,56 | 0,19 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,97 | 0,54 | 0,54 | 7.585.493,11 | 4,04 | 9.706.276.068,00 | 0,08 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 1,96 | 0,54 | 0,54 | 11.571.514,81 | 6,17 | 1.150.142.375,78 | 1,01 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP | 4,90 | 0,24 | 0,24 | 18.802.127,19 | 10,02 | 1.294.763.175,70 | 1,45 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 7,28 | -0,04 | -0,04 | 10.088.785,68 | 5,38 | 2.270.256.483,13 | 0,44 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,97 | 0,56 | 0,56 | 11.086.220,71 | 5,91 | 4.489.872.848,79 | 0,25 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 3,92 | 0,32 | 0,32 | 88.135.891,33 | 46,98 | | |

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 | 0,07 | 0,37 | 0,37 | 149.888,18 | 0,08 | 4.320.739.663,56 | 0,00 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,05 | 0,37 | 0,37 | 7.921.072,60 | 4,22 | 4.996.174.196,71 | 0,16 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,06 | 0,37 | 0,37 | 6.372.120,38 | 3,40 | 5.345.385.558,02 | 0,12 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 5,01 | 0,27 | 0,27 | 7.835.533,85 | 4,18 | 1.952.250.666,57 | 0,40 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,05 | 0,35 | 0,35 | 2.768.431,51 | 1,48 | 2.903.514.199,57 | 0,10 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | 7,30 | -0,03 | -0,03 | 4.524.215,52 | 2,41 | 339.453.001,55 | 1,33 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,04 | 0,30 | 0,30 | 96.991,75 | 0,05 | 487.819.881,57 | 0,02 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 2,05 | 0,56 | 0,56 | 11.911.048,83 | 6,35 | 841.556.111,01 | 1,42 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF ATIVO FIC | 2,45 | 0,34 | 0,34 | 4.553.537,94 | 2,43 | 853.720.753,34 | 0,53 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 1,92 | 0,35 | 0,35 | 46.132.840,56 | 24,59 | | |
| Renda Fixa | | | 3,23 | 0,32 | 0,32 | 134.268.731,89 | 71,57 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,43%

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 | 18,06 | -1,67 | -1,67 | 11.111.994,68 | 5,92 | 357.600.714,55 | 3,11 |
| CEF | CEF | FIA BRASIL IBX-50 | 18,10 | -1,56 | -1,61 | 10.621.115,91 | 5,66 | 1.285.266.984,85 | 0,83 |
| BB | BB | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 17,55 | -1,09 | -1,09 | 2.787.640,96 | 1,49 | 826.438.302,84 | 0,34 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 17,90 | -1,56 | -1,56 | 24.520.751,55 | 13,07 | | |

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 | 17,35 | -0,66 | -0,66 | 1.291.029,26 | 0,69 | 767.681.560,64 | 0,17 |
| BRAM | BEM | BRDESCO F I A SELECTION | 18,43 | -1,29 | -1,29 | 4.679.553,04 | 2,49 | 971.708.914,14 | 0,48 |
| BB | BB | BB AÇÕES DIVIDENDOS | 16,73 | -0,42 | -0,42 | 4.258.694,22 | 2,27 | 1.176.739.396,25 | 0,36 |
| BRAM | BEM | BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 15,95 | 1,61 | 1,61 | 6.544.843,58 | 3,49 | 2.245.635.949,92 | 0,29 |
| ITAU | ITAU | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 16,62 | 0,68 | 0,68 | 3.624.948,43 | 1,93 | 889.485.663,39 | 0,41 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 16,77 | 0,50 | 0,50 | 3.847.528,51 | 2,05 | 1.590.900.361,63 | 0,24 |
| BB | BB | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 17,15 | -1,38 | -1,38 | 4.563.447,35 | 2,43 | 427.681.839,30 | 1,07 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 16,33 | -0,08 | -0,08 | 28.810.044,39 | 15,36 | | |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

17,03 -0,79 -0,79 53.330.795,94 28,43

Total

6,46 0,07 0,07 187.599.527,83 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 88.135.891,33 | 46,98 | 20,00 | 30,00 | 60,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 46.132.840,56 | 24,59 | 0,00 | 30,00 | 40,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 134.268.731,89 | 71,57 | | | | 100,00 |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 24.520.751,55 | 13,07 | 0,00 | 20,00 | 30,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 28.810.044,39 | 15,36 | 0,00 | 10,00 | 20,00 | 20,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 53.330.795,94 | 28,43 | | | | 30,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

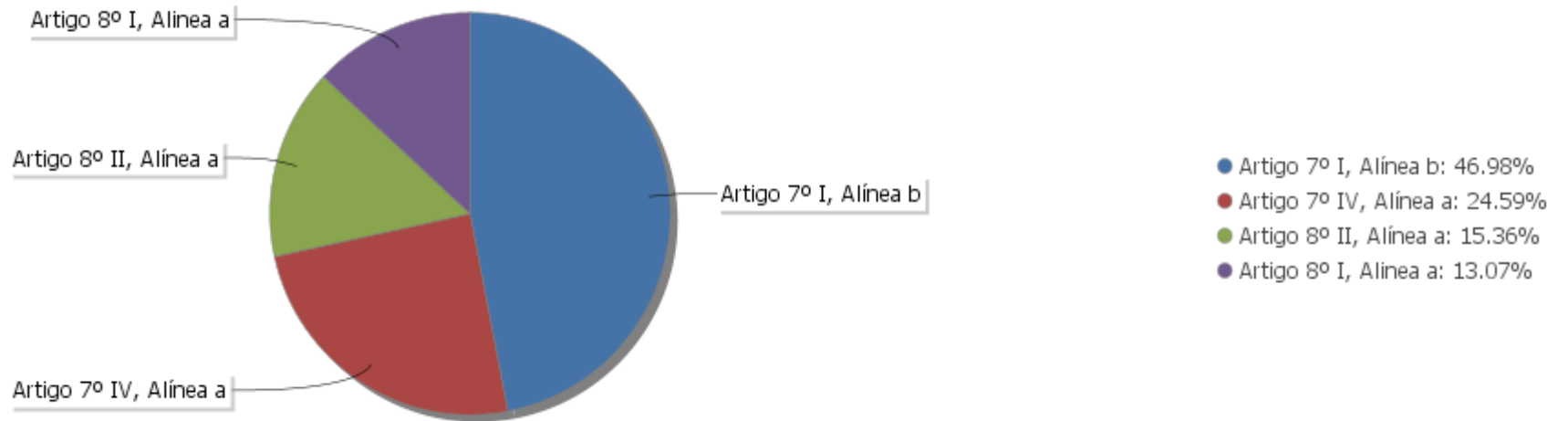
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|---------------|---------------|---------------|----------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,32 84,35 | 0,32 84,35 | 0,08 7,48 | 5,32 204,34 | 15,50 267,91 | 272.053,11 | 272.053,11 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,35 91,87 | 0,35 91,87 | 0,62 54,96 | 3,97 152,33 | 10,33 178,51 | 162.026,52 | 162.026,52 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -1,56 0,07 | -1,56 0,07 | 6,42 0,32 | 12,09 0,36 | 16,79 -0,02 | -336.857,79 | -336.857,79 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -0,08 1,55 | -0,08 1,55 | 10,38 4,28 | 16,22 4,49 | 25,77 8,96 | 17.174,95 | 17.174,95 |
| ILHA SOLTEIRA (Total) | | | | | | 114.396,79 | 114.396,79 |

Análise de Liquidez

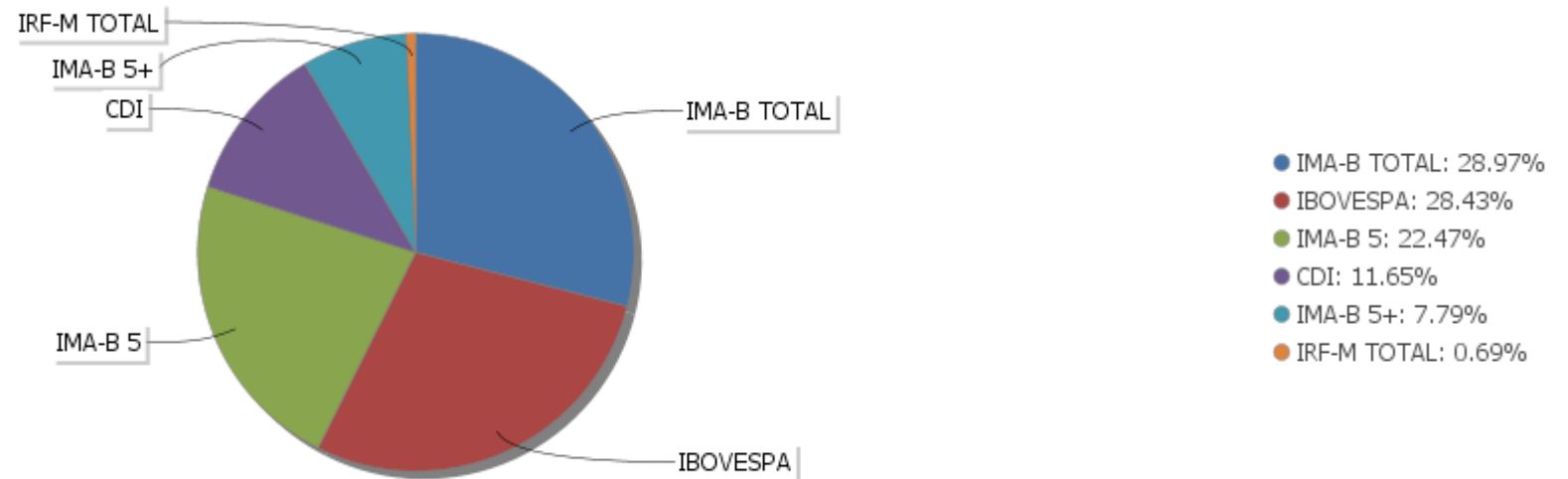
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 187.599.527,83 | 100,00 | 187.599.527,83 | 100,00 |
| de 31 a 364 dias | 0,00 | 0,00 | 187.599.527,83 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 187.599.527,83 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

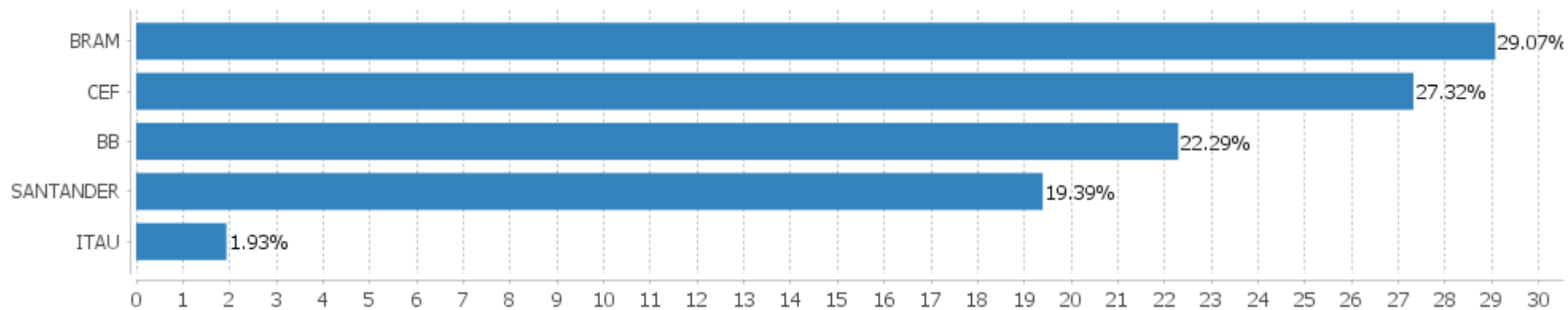


Alocação Por Estratégia



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 | | | | | | | | | | | | 0,07 |
| IPCA + 5,89% | 0,71 | | | | | | | | | | | | 0,71 |
| p.p. indexador | -0,64 | | | | | | | | | | | | -0,64 |
| 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

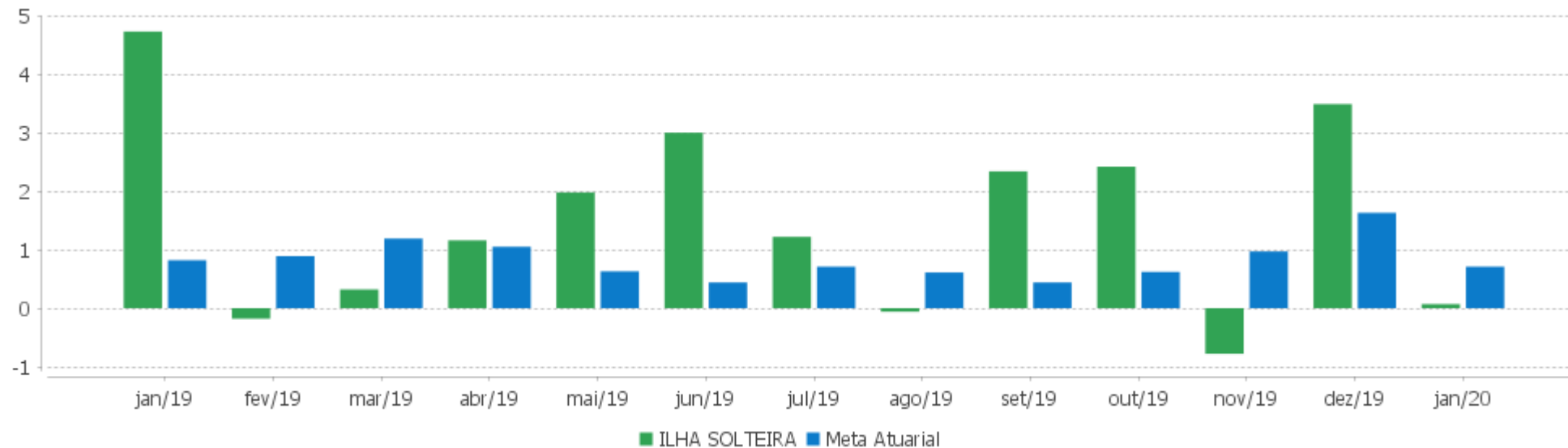
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 21 | 56,76 | 03 meses | 2,76 | 3,36 | -0,61 | 5,33 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 16 | 43,24 | 06 meses | 7,64 | 5,13 | 2,51 | 6,02 |
| | | | 12 meses | 15,94 | 10,46 | 5,49 | 6,46 |
| | | | 24 meses | 30,54 | 21,45 | 9,09 | 6,68 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,90 | 2018-10 | 36 meses | 49,35 | 32,32 | 17,03 | 6,54 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,68 | 2018-05 | Desde 30/12/2016 | 52,29 | 33,50 | 18,79 | 6,47 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,25 -0,01 | 0,25 -0,01 | -0,36 -0,12 | 5,44 -0,20 | 17,72 -0,40 | 34,14 -0,64 | 53,25 -1,07 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,54 -0,01 | 0,54 -0,01 | 1,41 -0,10 | 4,89 -0,15 | 11,76 -0,30 | 22,83 -0,53 | 38,27 -0,85 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,54 -0,02 | 0,54 -0,02 | 1,46 -0,05 | 4,92 -0,11 | 11,81 -0,25 | 22,85 -0,52 | 38,29 -0,83 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,56 -0,00 | 0,56 -0,00 | 1,44 -0,07 | 4,92 -0,12 | 11,82 -0,24 | 22,86 -0,50 | 38,36 -0,77 |
| BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p. | 0,85 -0,02 | 0,85 -0,02 | 0,98 -0,06 | 4,38 -0,12 | 11,22 -0,24 | 23,04 -0,50 | 39,99 -0,96 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,26 -0,00 | 0,26 -0,00 | -0,30 -0,06 | 5,54 -0,10 | 17,83 -0,29 | 34,11 -0,67 | 53,19 -1,13 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | -0,04 -0,07 | -0,04 -0,07 | -1,75 -0,21 | 5,77 -0,31 | 21,74 -0,59 | 42,13 -1,28 | 64,08 -1,90 |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,24 -0,02 | 0,24 -0,02 | -0,30 -0,07 | 5,50 -0,14 | 17,78 -0,34 | 34,07 -0,72 | 53,21 -1,11 |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,27 0,01 | 0,27 0,01 | -0,33 -0,09 | 5,66 0,02 | 17,92 -0,19 | 34,49 -0,30 | 54,10 -0,22 |
| BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p. | 0,56 0,00 | 0,56 0,00 | 1,40 -0,11 | 4,93 -0,10 | 11,79 -0,27 | 22,86 -0,50 | 38,61 -0,51 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI | 0,34 90,75 | 0,34 90,75 | 0,93 82,20 | 4,14 159,03 | 11,91 205,88 | 17,78 141,87 | |
| BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI | 0,37 98,23 | 0,37 98,23 | 1,07 94,62 | 2,51 96,33 | 5,66 97,86 | 12,30 98,18 | 23,30 100,90 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,35 92,89 | 0,35 92,89 | 1,05 92,35 | 2,45 94,13 | 5,55 95,98 | 12,19 97,29 | 22,86 99,00 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,37 98,46 | 0,37 98,46 | 1,03 91,06 | 2,44 93,73 | 5,55 95,93 | 12,08 96,40 | 22,61 97,91 |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p. | -0,03 -0,07 | -0,03 -0,07 | -1,66 -0,12 | 5,90 -0,18 | 21,84 -0,49 | 42,45 -0,96 | 64,16 -1,82 |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI | 0,37 99,51 | 0,37 99,51 | 1,06 93,34 | 2,46 94,35 | 5,63 97,34 | 12,30 98,14 | 23,07 99,93 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,30 | 0,30 | 0,92 | 2,17 | 4,90 | 10,67 | 20,08 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| % do CDI | 80,31 | 80,31 | 81,38 | 83,29 | 84,70 | 85,16 | 86,99 |
| FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p. | -1,61 0,02 | -1,61 0,02 | 6,46 0,36 | 11,64 -0,10 | 15,12 -1,69 | 27,89 -6,09 | 70,78 -5,13 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p. | -1,09 0,54 | -1,09 0,54 | 7,44 1,34 | 14,37 2,63 | 19,95 3,14 | 39,21 5,23 | 81,48 5,57 |
| BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p. | -1,67 -0,04 | -1,67 -0,04 | 6,10 -0,00 | 11,61 -0,13 | 16,54 -0,27 | 33,71 -0,27 | 74,86 -1,05 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p. | -1,38 0,25 | -1,38 0,25 | 7,59 1,49 | 13,66 1,92 | 19,47 2,66 | 37,50 3,52 | 73,62 -2,28 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p. | 0,50 2,13 | 0,50 2,13 | 18,51 12,41 | 24,23 12,50 | 41,26 24,46 | 56,18 22,21 | 119,71 43,80 |
| BRADERCO FIA SELECTION Var. IBOVESPA p.p. | -1,29 0,34 | -1,29 0,34 | 4,28 -1,82 | 11,26 -0,48 | 18,91 2,11 | 40,76 6,78 | 94,56 18,65 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p. | -0,66 0,97 | -0,66 0,97 | 8,58 2,48 | 14,32 2,58 | 21,35 4,55 | 41,20 7,23 | 90,90 14,99 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p. | 0,68 2,31 | 0,68 2,31 | 10,42 4,32 | 16,16 4,43 | 23,73 6,93 | 43,87 9,90 | 86,45 10,54 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p. | -0,42 1,21 | -0,42 1,21 | 7,87 1,77 | 11,61 -0,12 | 18,23 1,43 | 36,18 2,20 | 68,85 -7,06 |
| BRADERCO FIA EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p. | 1,61 3,24 | 1,61 3,24 | 15,57 9,47 | 21,71 9,97 | 35,76 18,96 | 71,51 37,54 | 134,27 58,36 |
| ILHA SOLTEIRA Var. IPCA + 5,89% p.p. | 0,07 -0,64 | 0,07 -0,64 | 2,76 -0,59 | 7,64 2,56 | 15,94 5,59 | 30,54 9,33 | 49,35 17,43 |
| CDI | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,53 | 23,09 |
| IBOVESPA | -1,63 | -1,63 | 6,10 | 11,74 | 16,80 | 33,97 | 75,91 |
| INPC + 6% | 0,70 | 0,70 | 3,46 | 5,16 | 10,59 | 21,35 | 30,95 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,72 | 3,37 | 5,14 | 10,47 | 21,46 | 32,33 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Indexadores

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Renda Fixa | | | | | | | |
| IRF-M 1 | 0,44 | 0,44 | 1,20 | 3,05 | 6,61 | 14,04 | 25,84 |
| IRF-M 1+ | 1,11 | 1,11 | 0,99 | 5,27 | 13,57 | 27,70 | 47,38 |
| IRF-M TOTAL | 0,88 | 0,88 | 1,04 | 4,50 | 11,47 | 23,54 | 40,94 |
| IMA-B 5 | 0,56 | 0,56 | 1,51 | 5,04 | 12,06 | 23,36 | 39,12 |
| IMA-B 5+ | 0,03 | 0,03 | -1,54 | 6,07 | 22,33 | 43,41 | 65,98 |
| IMA-B TOTAL | 0,26 | 0,26 | -0,24 | 5,64 | 18,11 | 34,79 | 54,32 |
| IMA-C TOTAL | 2,54 | 2,54 | 1,76 | 6,14 | 20,05 | 38,88 | 56,63 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,50 | 0,50 | 0,70 | 4,08 | 11,07 | 22,22 | 37,86 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,56 | 0,56 | 0,73 | 4,13 | 11,32 | 22,68 | 38,34 |
| IDKA 2 | 0,54 | 0,54 | 1,76 | 4,74 | 11,02 | 22,45 | 38,67 |
| IDKA 20 | -1,37 | -1,37 | -3,65 | 5,34 | 28,11 | 57,81 | 85,76 |
| CDI | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,53 | 23,09 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | -1,63 | -1,63 | 6,10 | 11,74 | 16,80 | 33,97 | 75,91 |
| IBRX 100 | -1,25 | -1,25 | 6,95 | 12,64 | 18,97 | 37,28 | 80,87 |
| IBRX 50 | -1,88 | -1,88 | 5,44 | 10,57 | 14,75 | 29,92 | 71,82 |
| SMALL CAP | 0,45 | 0,45 | 18,98 | 24,82 | 45,25 | 64,69 | 130,34 |
| IFIX | -3,76 | -3,76 | 10,22 | 15,71 | 27,70 | 34,66 | 59,06 |
| Índice Consumo - ICON | 3,66 | 3,66 | 15,32 | 21,23 | 43,29 | 43,57 | 87,57 |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,58 | -1,58 | 10,79 | 17,15 | 27,01 | 50,76 | 91,15 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,21 | 0,21 | 1,88 | 2,05 | 4,19 | 8,13 | 11,21 |
| INPC | 0,19 | 0,19 | 1,96 | 2,07 | 4,30 | 8,03 | 10,05 |
| IGPM | 0,48 | 0,48 | 2,89 | 2,88 | 7,81 | 15,07 | 14,60 |
| SELIC | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,54 | 23,11 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

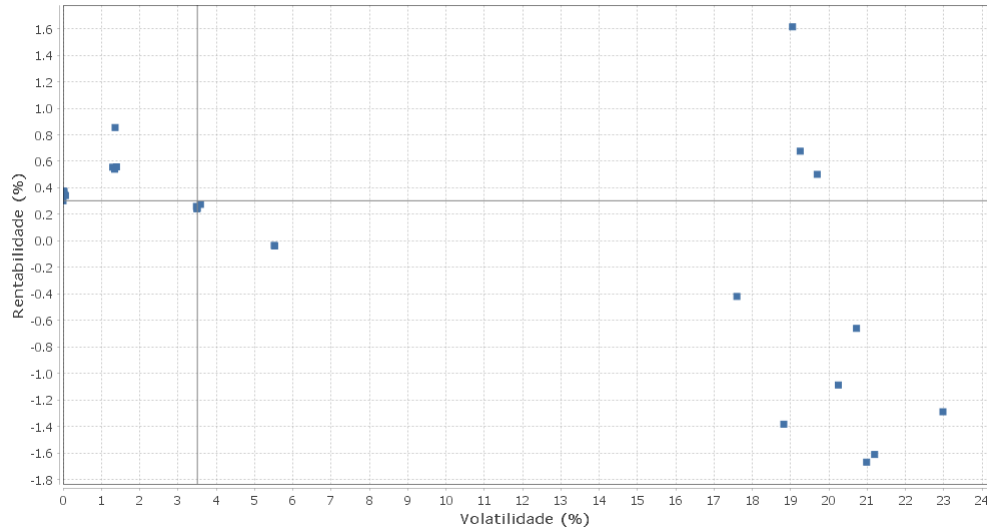
Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|--|--------------|--------------|------------------|----------------|
| 1 | 02/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 41.000,00 | 11.227,21406100 | 3,6518410000 |
| 2 | 08/01/2020 | SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 0,00 | 10.000,00 | 54,58259900 | 183,2085750000 |
| 3 | 13/01/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 900.000,00 | 0,00 | 399.857,83827600 | 2,2507999440 |
| 4 | 15/01/2020 | SANTANDER RF ATIVO FIC | 850.000,00 | 0,00 | 68.011,57992400 | 12,4978717000 |
| 5 | 16/01/2020 | BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS | 0,00 | 1.500.000,00 | 1.609,52141980 | 931,9540470000 |
| 6 | 16/01/2020 | BB AÇÕES DIVIDENDOS | 0,00 | 800.000,00 | 39.239,42806500 | 20,3876569930 |
| 7 | 16/01/2020 | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 0,00 | 800.000,00 | 365.279,61599600 | 2,1901030470 |
| 8 | 21/01/2020 | BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 1.400.000,00 | 0,00 | 733.928,17862720 | 1,9075436000 |
| 9 | 22/01/2020 | FIA BRASIL IBX-50 | 0,00 | 1.500.000,00 | 983.574,28529700 | 1,5250500368 |
| 10 | 23/01/2020 | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1.500.000,00 | 0,00 | 77.893,79754000 | 19,2569889690 |
| 11 | 23/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1.400.000,00 | 0,00 | 464.773,64361600 | 3,0122190000 |
| 12 | 29/01/2020 | SANTANDER RF ATIVO FIC | 0,00 | 360.000,00 | 28.756,06441500 | 12,5190984000 |
| 13 | 29/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 120.000,00 | 32.755,15946400 | 3,6635450000 |
| 14 | 29/01/2020 | BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 450.000,00 | 37.282,31000000 | 12,0700676000 |
| 15 | 29/01/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 200.000,00 | 88.692,02487800 | 2,2549941810 |
| Total | | | | | | |

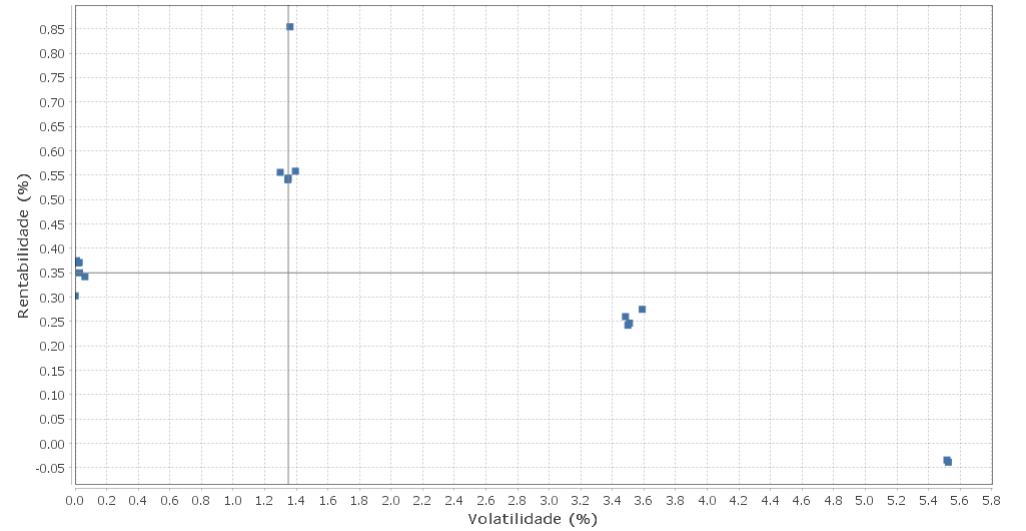
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

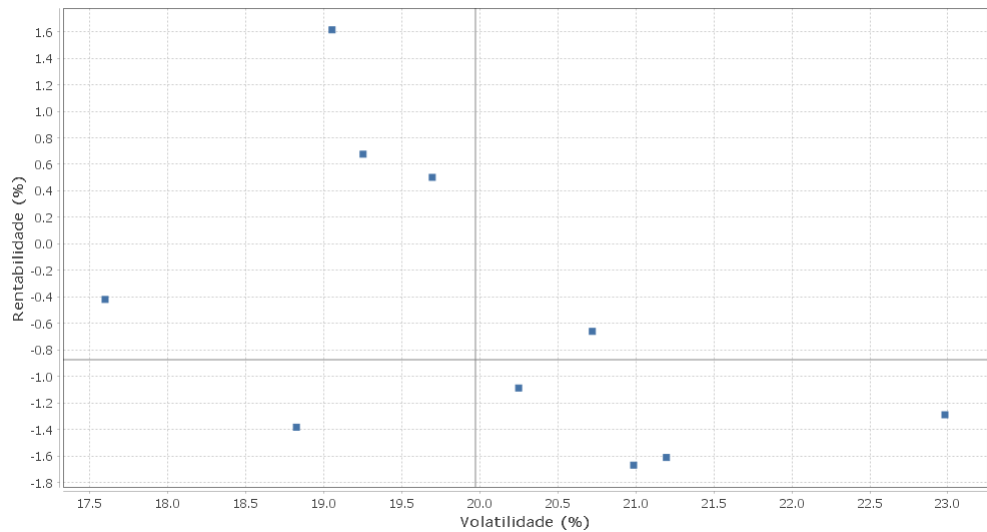
ILHA SOLTEIRA - No Mês



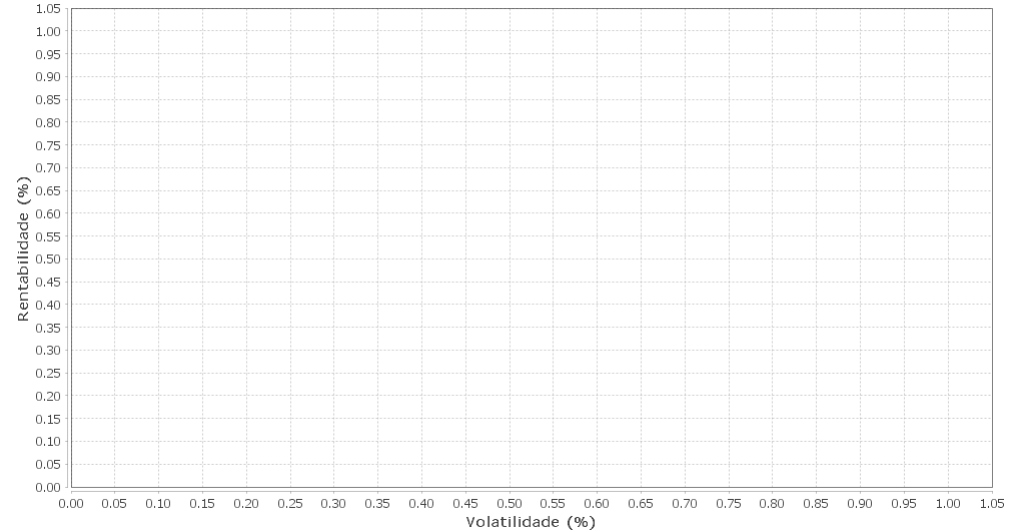
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.815.212,90

Value-At-Risk: 2,57%

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|------|-------|---------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,00 | 0,02 | 0,00 | -150,11 | 0,30 | 96.991,75 | 0,05 |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,01 | 0,02 | 0,00 | -0,20 | 0,37 | 149.888,18 | 0,08 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,02 | 0,02 | 0,00 | -0,39 | 0,37 | 7.921.072,60 | 4,22 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,02 | -0,00 | -0,22 | 0,37 | 6.372.120,38 | 3,40 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,02 | 0,00 | -0,93 | 0,35 | 2.768.431,51 | 1,48 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,06 | 0,82 | 0,01 | -0,56 | 0,34 | 4.553.537,94 | 2,43 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,30 | 0,83 | 0,03 | 0,14 | 0,56 | 11.086.220,71 | 5,91 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,35 | 0,81 | 0,03 | 0,12 | 0,54 | 11.571.514,81 | 6,17 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,35 | 0,81 | 0,02 | 0,12 | 0,54 | 7.585.493,11 | 4,04 |
| BB PREV RF IRF-M | Artigo 7º I, Alínea b | 1,36 | 0,97 | 0,00 | 0,35 | 0,85 | 1.294.022,54 | 0,69 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,39 | 0,85 | 0,03 | 0,13 | 0,56 | 11.911.048,83 | 6,35 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 3,48 | 2,32 | 0,12 | -0,03 | 0,26 | 15.066.683,73 | 8,03 |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 3,50 | 2,34 | 0,16 | -0,04 | 0,24 | 18.802.127,19 | 10,02 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 3,51 | 2,37 | 0,11 | -0,04 | 0,25 | 12.641.043,56 | 6,74 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | Artigo 7º IV, Alínea a | 3,59 | 2,36 | 0,07 | -0,03 | 0,27 | 7.835.533,85 | 4,18 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | Artigo 7º IV, Alínea a | 5,52 | 3,63 | 0,06 | -0,07 | -0,03 | 4.524.215,52 | 2,41 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 5,53 | 3,67 | 0,13 | -0,08 | -0,04 | 10.088.785,68 | 5,38 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 17,60 | 6,51 | 0,13 | -0,05 | -0,42 | 4.258.694,22 | 2,27 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 18,82 | 6,86 | 0,15 | -0,09 | -1,38 | 4.563.447,35 | 2,43 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | Artigo 8º II, Alínea a | 19,05 | 7,15 | 0,21 | 0,06 | 1,61 | 6.544.843,58 | 3,49 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | Artigo 8º II, Alínea a | 19,25 | 7,32 | 0,13 | 0,02 | 0,68 | 3.624.948,43 | 1,93 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 19,70 | 8,62 | 0,14 | 0,01 | 0,50 | 3.847.528,51 | 2,05 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | Artigo 8º I, Alínea a | 20,25 | 7,40 | 0,10 | -0,07 | -1,09 | 2.787.640,96 | 1,49 |
| SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES | Artigo 8º II, Alínea a | 20,72 | 6,41 | 0,04 | -0,05 | -0,66 | 1.291.029,26 | 0,69 |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | Artigo 8º I, Alínea a | 20,99 | 7,52 | 0,39 | -0,10 | -1,67 | 11.111.994,68 | 5,92 |
| FIA BRASIL IBX-50 | Artigo 8º I, Alínea a | 21,20 | 7,50 | 0,37 | -0,09 | -1,61 | 10.621.115,91 | 5,66 |
| BRADESCO F I A SELECTION | Artigo 8º II, Alínea a | 22,98 | 7,06 | 0,15 | -0,07 | -1,29 | 4.679.553,04 | 2,49 |