



**LDB**  
EMPRESAS

**GUARULHOS**  
NOVEMBRO 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 18.12.2020.

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

68,61%

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

| Gestor                                 | Admin.      | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|-------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| BB                                     | BB          | BB PREV RF IRF-M                                    | 6,08                | 0,34            | 4,35            | 11.722.843,09         | 2,84         | 4.734.232.270,41  | 0,25    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,57                | 0,20            | 3,15            | 12.541.689,27         | 3,03         | 7.844.641.875,20  | 0,16    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 12,85               | 1,99            | 1,17            | 9.087.373,16          | 2,20         | 5.938.047.265,27  | 0,15    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,55                | 0,22            | 3,34            | 12.608.655,22         | 3,05         | 13.835.706.591,01 | 0,09    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 5,04                | 1,29            | 5,82            | 3.872.379,00          | 0,94         | 19.732.912.783,40 | 0,02    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,14                | 1,22            | 6,28            | 6.979.748,58          | 1,69         | 10.336.804.140,67 | 0,07    |
| WESTERN                                | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                    | 9,25                | 1,44            | 6,72            | 20.211.422,32         | 4,89         | 771.960.508,33    | 2,62    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF IPCA                                     | 6,14                | 1,31            | 6,56            | 7.461.875,51          | 1,81         | 344.709.100,05    | 2,16    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF VII                                      | 2,42                | 1,17            | 4,35            | 352.362,82            | 0,09         | 242.932.832,47    | 0,15    |
| BB                                     | BB          | BB PREVIDENCIÁRIO XI TP                             | 4,95                | 1,17            | 6,99            | 6.739.942,40          | 1,63         | 201.186.012,36    | 3,35    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 6,28                | 0,85            | 2,65            | 13.295.359,79         | 3,22         | 9.499.641.282,04  | 0,14    |
| CEF                                    | CEF         | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 5,97                | 0,82            | 5,27            | 36.266.793,77         | 8,78         | 14.161.450.965,39 | 0,26    |
| SAFRA                                  | SAFRA       | SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF                    | 14,72               | 2,16            | 8,55            | 16.337.078,78         | 3,95         | 1.752.066.689,29  | 0,93    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF          | 8,75                | 1,55            | 6,07            | 4.293.535,00          | 1,04         | 458.978.220,23    | 0,94    |
| CEF                                    | CEF         | CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF        | 13,91               | 2,42            | 3,61            | 7.330.800,08          | 1,77         | 363.369.791,50    | 2,02    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |             |   | <b>5,93</b>         | <b>1,11</b>     | <b>4,46</b>     | <b>169.101.858,79</b> | <b>40,92</b> |                   |         |

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

| Gestor                                   | Admin. | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| MONGERAL                                 | BEM    | MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP | 13,19               | 1,99            | -0,42           | 5.974.536,42        | 1,45        | 143.100.730,36 | 4,18    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |   | <b>13,19</b>        | <b>1,99</b>     | <b>-0,42</b>    | <b>5.974.536,42</b> | <b>1,45</b> |                |         |

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                  | Admin.      | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|---|-------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| BNP PARIBAS                             | BNP PARIBAS | BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF                    | 14,12               | 1,98            | -0,42           | 2.987.473,76          | 0,72         | 248.423.623,51   | 1,20    |
| BRAM                                    | BRADERSCO   | BRADERSCO FI RF MAXI PODER PUBLICO            | 0,33                | 0,12            | 1,36            | 7.121.617,40          | 1,72         | 411.647.884,35   | 1,73    |
| BRAM                                    | BRADERSCO   | BRADERSCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL       | 5,99                | 0,86            | 3,69            | 10.377.305,19         | 2,51         | 737.367.516,27   | 1,41    |
| WESTERN                                 | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF               | 16,82               | 2,16            | 1,98            | 29.022.468,85         | 7,02         | 608.037.587,61   | 4,77    |
| BB                                      | BB          | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 0,23                | 0,16            | 2,14            | 4.660.379,72          | 1,13         | 2.405.684.296,02 | 0,19    |
| BB                                      | BB          | BB PREV RF FLUXO FIC                          | 0,16                | 0,06            | 1,54            | 19.905.560,24         | 4,82         | 1.893.436.284,11 | 1,05    |
| CEF                                     | CEF         | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF           | 0,06                | 0,08            | 1,81            | 96.596,31             | 0,02         | 625.949.083,71   | 0,02    |
| ITAU                                    | ITAU        | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,67                | 0,10            | 2,65            | 11.802.605,64         | 2,86         | 4.356.779.873,38 | 0,27    |
| BRAM                                    | BRADERSCO   | BRADERSCO FI RF IDKA PRE 2                    | 5,74                | 0,48            | 6,16            | 22.506.768,69         | 5,45         | 967.002.321,08   | 2,33    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |             |   | <b>4,60</b>         | <b>0,90</b>     | <b>1,98</b>     | <b>108.480.775,80</b> | <b>26,25</b> |                  |         |
| <b>Renda Fixa</b>                       |             |   | <b>5,26</b>         | <b>1,06</b>     | <b>3,31</b>     | <b>283.557.171,01</b> | <b>68,61</b> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,73%

## 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 |
|---|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRAM                                    | BEM    | BRABESCO F I A SELECTION                | 44,33               | 8,19            | -10,73          | 2.820.433,99         | 0,68         | 767.879.921,64   | 0,37    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES        | 37,89               | 14,05           | -4,36           | 13.028.434,27        | 3,15         | 763.972.967,60   | 1,71    |
| CONSTÂNCIA                              | BEM    | CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES       | 41,22               | 13,48           | 7,29            | 4.291.688,24         | 1,04         | 1.143.672.226,64 | 0,38    |
| QUELUZ                                  | BEM    | QUELUZ VALOR FI EM ACOES                | 42,86               | 2,72            | 2,72            | 2.054.303,78         | 0,50         | 116.318.158,19   | 1,77    |
| CONSTÂNCIA                              | BEM    | CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA             | 42,41               | 14,01           | -13,19          | 11.925.578,83        | 2,89         | 288.791.292,45   | 4,13    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI SELECTION EQUITIES FIA            | 38,84               | 10,96           | 1,28            | 16.380.474,32        | 3,96         | 518.958.956,99   | 3,16    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI MOSAICO FIA                       | 42,69               | 13,01           | -5,24           | 11.110.974,20        | 2,69         | 1.564.882.734,75 | 0,71    |
| AZ QUEST                                | BEM    | AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA | 46,75               | 11,65           | 37,31           | 13.164.385,21        | 3,19         | 520.757.864,58   | 2,53    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |   | <b>40,45</b>        | <b>12,48</b>    | <b>-6,50</b>    | <b>74.776.272,84</b> | <b>18,09</b> |                  |         |

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor                         | Admin.      | Ativo                                      | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|--------------------------------|-------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| WESTERN                        | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 33,40               | 10,70           | 8,11            | 5.945.796,13         | 1,44        | 1.120.524.946,30 | 0,53    |
| SAFRA                          | SAFRA       | SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO         | 32,78               | 10,58           | 35,86           | 21.183.739,90        | 5,13        | 647.909.280,33   | 3,27    |
| MONGERAL                       | BEM         | MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO             | 2,27                | 0,88            | 0,88            | 3.026.512,85         | 0,73        | 133.469.592,25   | 2,27    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b> |             |  | <b>19,16</b>        | <b>9,55</b>     | <b>28,12</b>    | <b>30.156.048,88</b> | <b>7,30</b> |                  |         |

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

| Gestor                                  | Admin. | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|---|--------|--------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| RIO BRAVO                               | CEF    | RBBV11 | 14,56               | 5,81            | 10,54           | 1.404.000,00        | 0,34        | 126.230.937,11 | 1,11    |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b> |        |        | <b>14,56</b>        | <b>5,81</b>     | <b>10,54</b>    | <b>1.404.000,00</b> | <b>0,34</b> |                |         |

**Renda Variável e Investimentos Estruturados**
**38,07**
**11,54**
**-5,38**
**106.336.321,72**
**25,73**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,66%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor                           | Admin.      | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira    | PL do Fundo      | % Fundo |
|----------------------------------|-------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|---------------|------------------|---------|
| BNP PARIBAS                      | BNP PARIBAS | ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR         | 8,09                | 4,22            | 2,90            | 2.469.557,50          | 0,60          | 99.325.824,68    | 2,49    |
| BNP PARIBAS                      | BNP PARIBAS | ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR               | 28,85               | 2,79            | -0,50           | 4.248.826,57          | 1,03          | 142.560.197,78   | 2,98    |
| XP                               | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 29,15               | 3,60            | 6,25            | 7.145.487,50          | 1,73          | 1.165.879.862,43 | 0,61    |
| WESTERN                          | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR  | 12,20               | 5,77            | 4,21            | 9.522.695,46          | 2,30          | 1.018.047.104,97 | 0,94    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, II</b> |             |   | <b>12,86</b>        | <b>4,39</b>     | <b>4,02</b>     | <b>23.386.567,03</b>  | <b>5,66</b>   |                  |         |
| <b>Investimentos no Exterior</b> |             |   | <b>12,86</b>        | <b>4,39</b>     | <b>4,02</b>     | <b>23.386.567,03</b>  | <b>5,66</b>   |                  |         |
| <b>Total</b>                     |             |   | <b>9,57</b>         | <b>3,82</b>     | <b>3,19</b>     | <b>413.280.059,76</b> | <b>100,00</b> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

| Artigo   | Tipo de Ativo  | Valor(R\$)            | % Carteira   | Política de Investimentos |          |        |              |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
|  |  |                       |              | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>                                  |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 7º I, Alínea b                              | Fundos 100% Títulos Públicos                             | 169.101.858,79        | 40,92        | 20,00                     | 50,00    | 90,00  | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                            | Fundos Renda Fixa Referenciados                          | 5.974.536,42          | 1,45         | 0,00                      | 0,00     | 15,00  | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                             | Fundos de Renda Fixa                                     | 108.480.775,80        | 26,25        | 5,00                      | 20,00    | 40,00  | 40,00        |
|  | <b>Total Renda Fixa</b>                                  | <b>283.557.171,01</b> | <b>68,61</b> |                           |          |        |              |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 8º II, Alínea a                             | Fundos de Ações  | 74.776.272,84         | 18,09        | 0,00                      | 20,00    | 20,00  | 20,00        |
| Artigo 8º III                                      | Fundos Multimercados                                     | 30.156.048,88         | 7,30         | 0,00                      | 2,00     | 10,00  | 10,00        |
| Artigo 8º IV, Alínea b                             | Fundos de Investimentos Imobiliários                     | 1.404.000,00          | 0,34         | 0,00                      | 1,00     | 3,00   | 5,00         |
|  | <b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> | <b>106.336.321,72</b> | <b>25,73</b> |                           |          |        |              |
| <b>Investimentos no Exterior</b>                   |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 9º A, II                                    | Fundos de Investimento no Exterior                       | 23.386.567,03         | 5,66         | 0,00                      | 3,00     | 10,00  | 10,00        |
|  | <b>Total Investimentos no Exterior</b>                   | <b>23.386.567,03</b>  | <b>5,66</b>  |                           |          |        |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

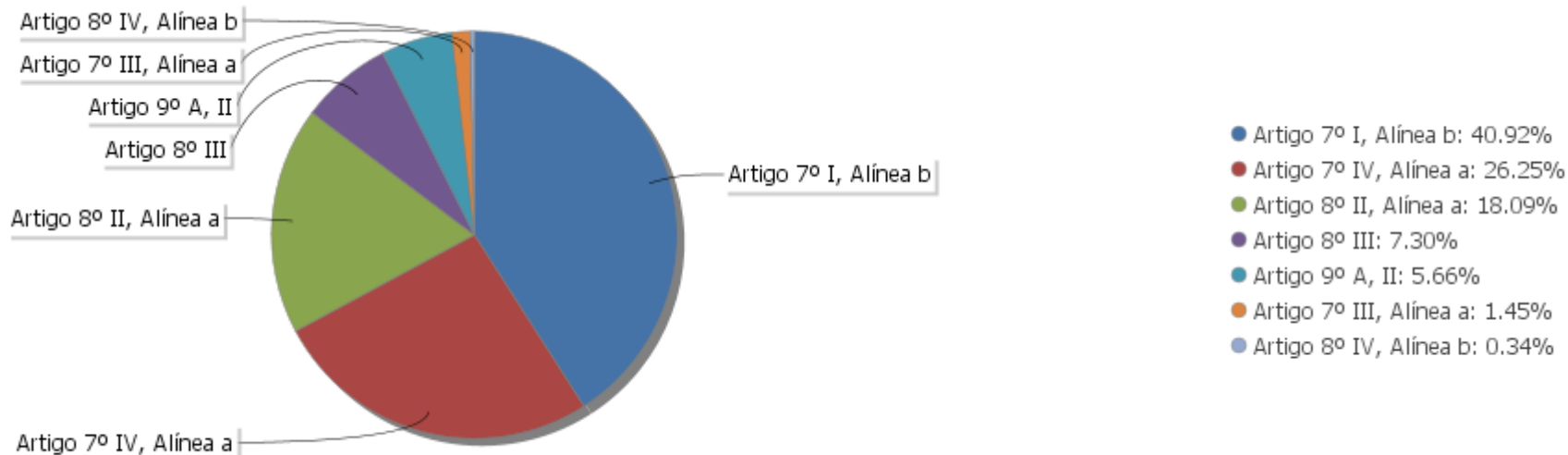
| Estratégia Indexador                         | No Mês           | No Ano           | 3 meses         | 6 meses        | 12 meses         | No Mês(R\$)          | No Ano(R\$)          |
|--|------------------|------------------|-----------------|----------------|------------------|----------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | 1,11<br>744,40   | 4,46<br>172,33   | 0,35<br>75,17   | 2,44<br>235,45 | 5,46<br>183,45   | 1.862.516,08         | 6.239.613,37         |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | 1,99<br>1.330,98 | -0,42<br>-85,88  | 0,28<br>61,26   |                |                  | 116.555,61           | -25.463,58           |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 0,90<br>601,94   | 1,98<br>76,46    | -0,21<br>-44,88 | 1,29<br>124,99 | 2,55<br>85,71    | 897.018,86           | 2.264.871,73         |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 0,00<br>0,00     | -4,67<br>-180,55 | 0,00<br>0,00    | 0,29<br>28,37  | -4,20<br>-141,09 | 0,00                 | -162.937,74          |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 12,48<br>-3,42   | -6,50<br>-0,66   | 6,03<br>-3,55   | 20,47<br>-4,12 | 1,99<br>1,38     | 8.117.841,75         | 1.908.401,09         |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | 9,55<br>-6,35    | 28,12<br>33,95   | 1,89<br>-7,69   | 16,00<br>-8,59 | 28,98<br>28,37   | 2.628.786,80         | 2.311.474,90         |
| Artigo 8º IV, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | 5,81<br>-10,09   | 10,54<br>16,38   | 4,35<br>-5,23   | 7,86<br>-16,73 | 12,23<br>11,62   | 77.152,26            | 135.916,31           |
| Artigo 9º A, II<br>% do CDI                  | 4,39<br>2.935,18 | 4,02<br>155,38   | 3,14<br>677,34  | 9,29<br>898,25 |                  | 983.025,63           | 897.303,03           |
| <b>GUARULHOS - CONSOLIDADO (Total)</b>       |                  |                  |                 |                |                  | <b>14.682.896,99</b> | <b>13.569.179,11</b> |

## Análise de Liquidez

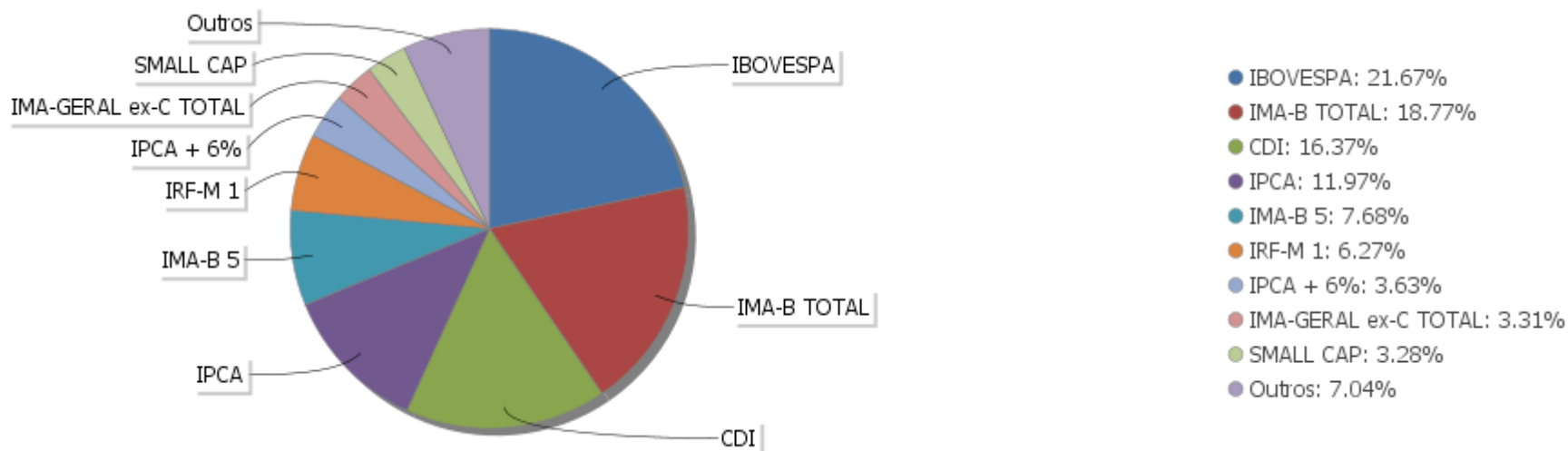
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 346.581.661,16 | 83,86 | 346.581.661,16        | 83,86     |
| de 31 a 364 dias  | 40.519.882,79  | 9,80  | 387.101.543,95        | 93,67     |
| acima de 365 dias | 26.178.515,81  | 6,33  | 413.280.059,76        | 100,00    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

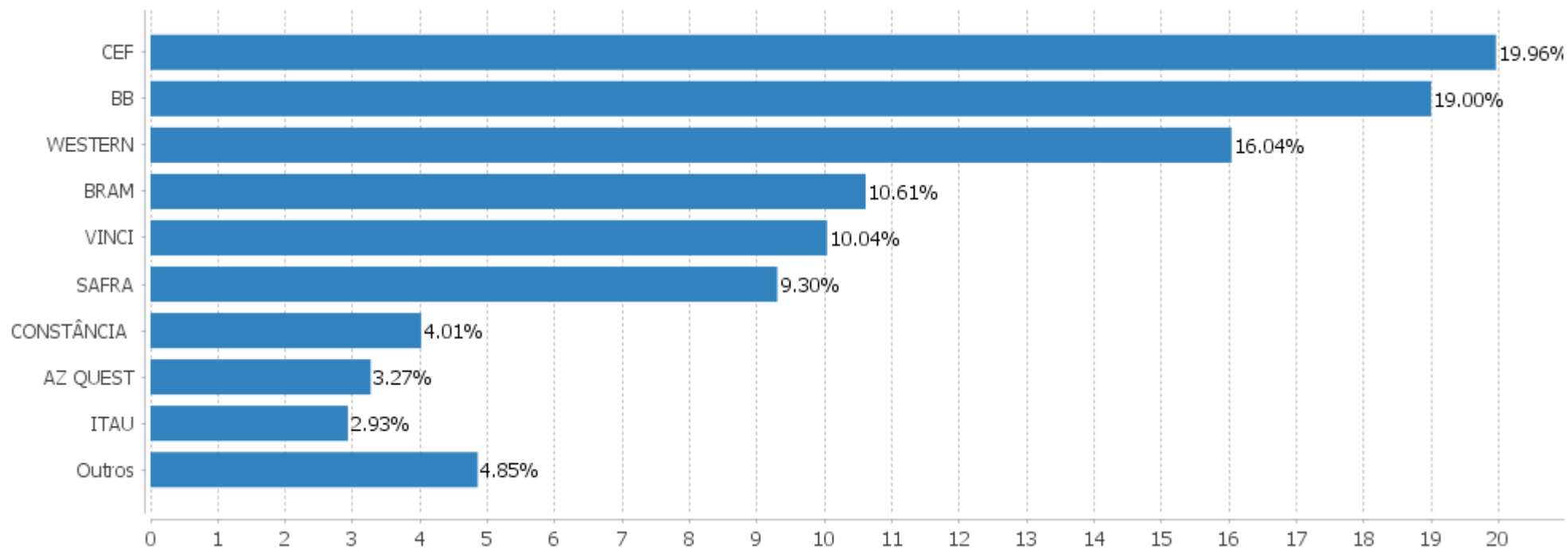


Alocação Por Estratégia



## 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           | 0,53  | -0,88 | -6,05 | 2,01  | 2,03  | 2,14  | 3,14 | -1,11 | -1,67 | -0,41 | 3,82  |      | 3,19      |
| INPC + 5,88%   | 0,69  | 0,58  | 0,68  | 0,22  | 0,20  | 0,78  | 0,97 | 0,84  | 1,35  | 1,37  | 1,41  |      | 9,47      |
| p.p. indexador | -0,16 | -1,46 | -6,73 | 1,78  | 1,83  | 1,36  | 2,17 | -1,95 | -3,02 | -1,78 | 2,41  |      | -6,28     |
| 2019           | 2,07  | 0,41  | 0,50  | 0,79  | 1,47  | 1,74  | 0,86 | 0,16  | 1,41  | 1,46  | -0,04 | 2,38 | 14,00     |
| INPC + 6%      | 0,87  | 1,01  | 1,21  | 1,09  | 0,66  | 0,45  | 0,63 | 0,63  | 0,44  | 0,57  | 1,01  | 1,71 | 10,78     |
| p.p. indexador | 1,20  | -0,59 | -0,71 | -0,30 | 0,81  | 1,29  | 0,23 | -0,47 | 0,98  | 0,88  | -1,05 | 0,67 | 3,22      |
| 2018           | 2,20  | 0,71  | 1,15  | 0,15  | -1,66 | 0,02  | 1,59 | -0,00 | 0,57  | 3,13  | 0,57  | 0,96 | 9,71      |
| INPC + 6%      | 0,74  | 0,60  | 0,56  | 0,70  | 0,92  | 1,92  | 0,76 | 0,53  | 0,74  | 0,91  | 0,21  | 0,60 | 9,59      |
| p.p. indexador | 1,46  | 0,11  | 0,59  | -0,55 | -2,57 | -1,91 | 0,83 | -0,53 | -0,17 | 2,21  | 0,36  | 0,36 | 0,12      |

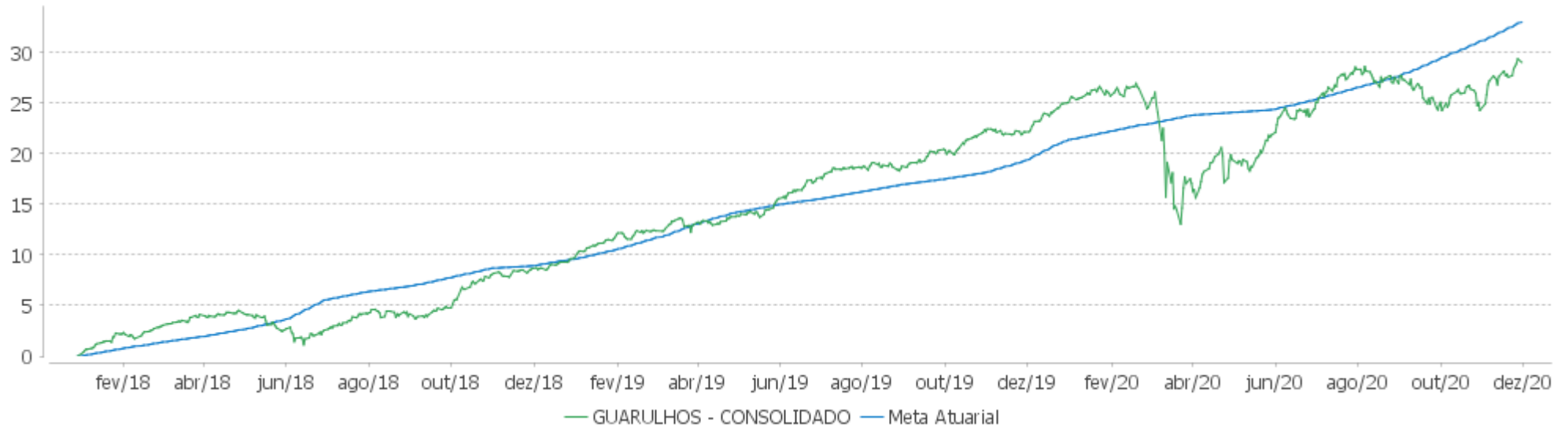
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

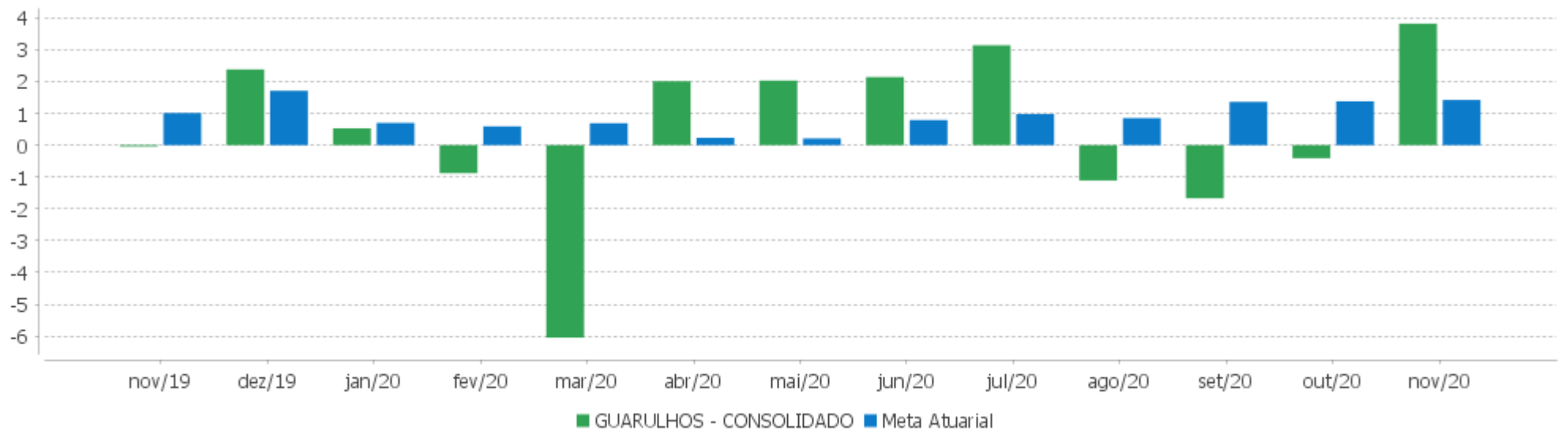
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 19         | 54,29     | 03 meses         | 1,66     | 4,19          | -2,52      | 6,46               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 16         | 45,71     | 06 meses         | 5,91     | 6,90          | -0,99      | 5,91               |
|                                 |            |           | 12 meses         | 5,65     | 11,34         | -5,70      | 9,57               |
|                                 |            |           | 24 meses         | 18,77    | 22,00         | -3,23      | 6,96               |
|                                 |            |           | 36 meses         |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,82       | 2020-11   |                  |          |               |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,05      | 2020-03   | Desde 29/12/2017 | 29,06    | 32,89         | -3,83      | 6,01               |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                       | No Mês         | No Ano         | 3 meses          | 6 meses       | 12 meses       | 24 meses        | 36 meses        |
|---|----------------|----------------|------------------|---------------|----------------|-----------------|-----------------|
| BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO<br>% do CDI                         | 0,12<br>80,74  | 1,97<br>75,98  | 0,05<br>10,43    | 0,55<br>53,31 | 2,33<br>78,26  | 8,26<br>89,44   | 14,96<br>91,76  |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.              | 2,16<br>0,16   | 1,98<br>0,50   | -0,34<br>-1,01   | 4,45<br>-0,86 | 4,19<br>0,67   | 31,41<br>4,59   | 48,52<br>6,28   |
| BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                   | 1,98<br>-0,02  | 0,83<br>-0,65  | 0,36<br>-0,31    | 4,99<br>-0,32 | 3,00<br>-0,52  | 26,80<br>-0,03  | 41,64<br>-0,60  |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                        | 0,16<br>105,63 | 2,14<br>82,75  | 0,34<br>73,60    | 1,02<br>98,87 | 2,50<br>84,20  | 8,51<br>92,13   | 15,52<br>95,17  |
| BRADERCO FI RF IDKA PRE 2<br>% do CDI                                 | 0,48<br>320,35 | 6,16<br>238,06 | -0,82<br>-175,76 | 0,38<br>36,79 | 6,73<br>226,44 | 20,45<br>221,28 | 33,65<br>206,37 |
| BB PREV RF FLUXO FIC<br>% do CDI                                      | 0,06<br>39,20  | 1,54<br>59,41  | 0,11<br>24,63    | 0,42<br>40,72 | 1,83<br>61,45  | 6,86<br>74,29   | 12,56<br>77,02  |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.       | 0,10<br>-0,79  | 2,65<br>-0,47  | -0,05<br>-2,46   | 0,82<br>-2,48 | 3,01<br>-1,30  | 16,62<br>8,89   | 25,32<br>13,23  |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL<br>Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.   | 0,86<br>0,12   | 3,69<br>0,44   | 0,42<br>0,20     | 2,74<br>0,38  | 4,65<br>0,48   | 18,43<br>0,58   | 29,97<br>0,66   |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF<br>% do CDI                       | 0,08<br>55,06  | 1,81<br>69,89  | 0,26<br>55,22    | 0,61<br>58,88 | 2,12<br>71,33  | 7,43<br>80,43   | 13,44<br>82,44  |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B 5 p.p.                 | 1,44<br>0,12   | 6,72<br>0,63   | 0,33<br>-1,07    | 3,27<br>-0,72 | 8,22<br>0,81   | 26,37<br>4,68   | 39,91<br>6,85   |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,99<br>-0,01  | 1,17<br>-0,32  | 0,62<br>-0,05    | 5,19<br>-0,12 | 3,18<br>-0,34  | 26,04<br>-0,79  | 41,07<br>-1,17  |
| BB PREVIDENCIÁRIO XI TP<br>Var. IMA-B 5 p.p.                          | 1,17<br>-0,15  | 6,99<br>0,90   | 1,87<br>0,47     | 4,74<br>0,75  | 8,25<br>0,84   | 24,04<br>2,35   | 36,34<br>3,27   |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.   | 1,29<br>-0,03  | 5,82<br>-0,28  | 1,31<br>-0,09    | 3,83<br>-0,16 | 7,10<br>-0,31  | 21,07<br>-0,62  | 32,11<br>-0,96  |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.        | 0,20<br>-0,03  | 3,15<br>-0,38  | 0,35<br>-0,19    | 0,93<br>-0,25 | 3,56<br>-0,40  | 10,43<br>-0,70  | 17,92<br>-0,98  |
| FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | 1,55<br>-0,45  | 6,07<br>4,59   | 0,59<br>-0,08    | 3,38<br>-1,93 | 7,65<br>4,13   | 26,89<br>0,06   | 40,16<br>-2,08  |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.             | 2,16<br>0,17   | 1,93<br>0,45   | -0,23<br>-0,90   | 4,61<br>-0,70 | 4,21<br>0,70   | 28,96<br>2,13   |                 |
| BB PREV RF VII  | 1,17           | 4,35           | 1,86             | 3,69          | 5,31           | 16,61           | 27,51           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia  | No Mês         | No Ano          | 3 meses        | 6 meses         | 12 meses       | 24 meses       | 36 meses       |
|--|----------------|-----------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|
| Var. IMA-B TOTAL p.p.  | -0,83          | 2,87            | 1,19           | -1,62           | 1,79           | -10,22         | -14,73         |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.           | 0,85<br>0,15   | 2,65<br>-0,02   | 0,02<br>0,04   | 1,84<br>-0,02   | 3,63<br>0,03   | 17,42<br>0,43  | 28,71<br>0,61  |
| BB PREV RF IPCA<br>Var. IPCA + 6% p.p.                                       | 1,31<br>-0,05  | 6,56<br>-2,18   | 0,63<br>-3,26  | 3,60<br>-2,77   | 8,10<br>-2,42  | 25,66<br>4,67  | 38,55<br>5,17  |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.               | 0,82<br>-0,07  | 5,27<br>2,15    | 0,20<br>-2,20  | 1,37<br>-1,92   | 5,90<br>1,59   | 24,20<br>16,47 | 33,20<br>21,12 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p.      | 1,22<br>-0,03  | 6,28<br>-0,49   | 1,41<br>0,10   | 4,27<br>-0,06   | 7,44<br>-0,61  | 19,53<br>-1,35 | 30,28<br>-2,28 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.             | 0,22<br>-0,01  | 3,34<br>-0,18   | 0,49<br>-0,05  | 1,09<br>-0,09   | 3,75<br>-0,20  | 10,70<br>-0,43 | 18,27<br>-0,63 |
| BB PREV RF IRF-M<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.                                    | 0,34<br>-0,02  | 4,35<br>-0,30   | -0,63<br>-0,10 | 0,45<br>-0,13   | 4,98<br>-0,32  | 18,41<br>-0,63 | 30,51<br>-0,92 |
| CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.        | 2,42<br>0,42   | 3,61<br>2,13    | 0,61<br>-0,06  | 5,75<br>0,44    | 4,75<br>1,23   | 29,49<br>2,66  | 46,23<br>3,99  |
| MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,99<br>-0,01  | 1,32<br>-0,16   | 0,28<br>-0,39  | 4,81<br>-0,50   | 3,38<br>-0,14  | 26,68<br>-0,14 | 41,34<br>-0,90 |
| CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.                      | 13,48<br>-2,42 | -11,77<br>-5,93 | 6,55<br>-3,04  | 15,93<br>-8,66  | -1,09<br>-1,69 | 35,53<br>13,87 | 74,39<br>23,09 |
| BRADERCO F I A SELECTION<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | 8,19<br>-7,71  | -10,73<br>-4,89 | 8,74<br>-0,85  | 28,88<br>4,29   | -4,31<br>-4,92 | 14,22<br>-7,45 | 51,90<br>0,60  |
| VINCI MOSAICO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                      | 13,01<br>-2,89 | -5,24<br>0,60   | 7,85<br>-1,74  | 22,37<br>-2,22  | 6,45<br>5,84   | 48,06<br>26,40 | 73,94<br>22,64 |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                           | 10,96<br>-4,94 | 1,28<br>7,12    | 4,68<br>-4,91  | 20,46<br>-4,12  | 9,08<br>8,47   | 35,65<br>13,98 | 71,46<br>20,16 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA<br>Var. SMALL CAP p.p.               | 11,65<br>-4,99 | -10,25<br>-2,65 | 2,89<br>-4,89  | 23,15<br>-10,24 |                |                |                |
| VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES<br>Var. IBOVESPA p.p.                       | 14,05<br>-1,86 | -4,36<br>1,48   | 8,83<br>-0,76  | 18,60<br>-5,99  | 4,65<br>4,04   | 39,67<br>18,01 | 57,67<br>6,37  |
| CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                            | 14,01<br>-1,89 | -13,19<br>-7,35 | 6,00<br>-3,58  | 17,48<br>-7,11  | -5,73<br>-6,34 | 15,08<br>-6,59 | 49,51<br>-1,79 |
| QUELUZ VALOR FI EM ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | 12,45<br>-3,46 | -12,13<br>-6,29 | 4,60<br>-4,98  | 19,60<br>-4,99  | -5,43<br>-6,04 | 20,56<br>-1,10 | 43,72<br>-7,58 |
| RBBV11<br>Var. IFIX p.p.   | 5,81<br>4,30   | 10,54<br>22,71  | 4,11<br>3,16   | 7,90<br>2,22    | 12,23<br>15,05 | 46,32<br>24,24 | 28,76<br>1,85  |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO                                   | 10,70          | 8,71            | 2,83           | 17,13           | 11,55          | 32,21          | 42,72          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia  | No Mês       | No Ano       | 3 meses     | 6 meses      | 12 meses     | 24 meses      | 36 meses     |
|--|--------------|--------------|-------------|--------------|--------------|---------------|--------------|
| % do CDI   | 7.156,35     | 336,28       | 610,70      | 1.655,69     | 388,47       | 348,62        | 262,02       |
| <b>MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO</b>                                    | <b>0,88</b>  | <b>1,56</b>  | <b>0,36</b> | <b>1,74</b>  | <b>2,17</b>  | <b>8,23</b>   |              |
| % do CDI   | 591,18       | 60,35        | 78,22       | 167,88       | 72,95        | 89,11         |              |
| <b>SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO</b>                                | <b>10,58</b> | <b>9,23</b>  | <b>2,87</b> | <b>17,11</b> | <b>12,10</b> | <b>32,33</b>  | <b>42,85</b> |
| Var. IBOVESPA p.p.   | -5,32        | 15,07        | -6,72       | -7,48        | 11,49        | 10,66         | -8,45        |
| <b>WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>  | <b>5,77</b>  | <b>4,21</b>  | <b>3,02</b> | <b>9,48</b>  | <b>8,02</b>  | <b>28,43</b>  |              |
| Var. INPC + 6% p.p.  | 4,36         | -5,38        | -1,20       | 2,52         | -3,44        | 6,30          |              |
| <b>ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>               | <b>2,79</b>  | <b>73,34</b> | <b>0,63</b> | <b>23,54</b> | <b>69,77</b> | <b>114,38</b> |              |
| Var. IBOVESPA p.p.   | -13,11       | 79,18        | -8,96       | -1,05        | 69,16        | 92,71         |              |
| <b>ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>         | <b>4,22</b>  | <b>-1,37</b> | <b>2,65</b> | <b>6,56</b>  | <b>0,08</b>  | <b>18,91</b>  |              |
| % do CDI   | 2.820,88     | -52,86       | 571,30      | 633,90       | 2,74         | 204,66        |              |
| <b>MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b> | <b>3,60</b>  | <b>90,97</b> | <b>5,60</b> | <b>35,40</b> | <b>86,64</b> |               |              |
| Var. IPCA + 6% p.p.  | 2,24         | 82,24        | 1,71        | 29,03        | 76,12        |               |              |
| <b>GUARULHOS - CONSOLIDADO</b>   | <b>3,82</b>  | <b>3,19</b>  | <b>1,66</b> | <b>5,91</b>  | <b>5,65</b>  | <b>18,77</b>  |              |
| Var. INPC + 6% p.p.  | 2,40         | -6,39        | -2,55       | -1,05        | -5,81        | -3,36         |              |
| CDI  | 0,15         | 2,59         | 0,46        | 1,03         | 2,97         | 9,24          | 16,31        |
| IBOVESPA   | 15,90        | -5,84        | 9,58        | 24,59        | 0,61         | 21,66         | 51,30        |
| INPC + 6%  | 1,42         | 9,58         | 4,22        | 6,96         | 11,46        | 22,12         | 33,99        |
| IPCA + 6%  | 1,36         | 8,73         | 3,89        | 6,37         | 10,52        | 20,99         | 33,37        |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

| Indexador                     | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| <b>Renda Fixa</b>             |        |        |         |         |          |          |          |
| IRF-M 1                       | 0,23   | 3,52   | 0,54    | 1,19    | 3,95     | 11,13    | 18,89    |
| IRF-M 1+                      | 0,46   | 5,24   | -1,06   | 0,29    | 6,00     | 22,54    | 36,94    |
| IRF-M TOTAL                   | 0,36   | 4,65   | -0,53   | 0,58    | 5,30     | 19,04    | 31,44    |
| IMA-B 5                       | 1,32   | 6,10   | 1,40    | 3,99    | 7,41     | 21,69    | 33,06    |
| IMA-B 5+                      | 2,59   | -1,87  | 0,14    | 6,53    | 0,68     | 30,33    | 48,80    |
| IMA-B TOTAL                   | 2,00   | 1,48   | 0,67    | 5,31    | 3,52     | 26,83    | 42,23    |
| IMA-C TOTAL                   | 1,94   | 23,44  | 7,90    | 19,17   | 23,94    | 48,54    | 75,37    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | 0,70   | 2,67   | -0,02   | 1,86    | 3,60     | 17,00    | 28,09    |
| IMA-GERAL TOTAL               | 0,73   | 3,25   | 0,22    | 2,35    | 4,17     | 17,84    | 29,30    |
| IDKA 2                        | 1,25   | 6,77   | 1,31    | 4,33    | 8,05     | 20,89    | 32,56    |
| IDKA 20                       | 3,37   | -8,22  | -0,40   | 9,06    | -4,60    | 35,17    | 60,63    |
| CDI                           | 0,15   | 2,59   | 0,46    | 1,03    | 2,97     | 9,24     | 16,31    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | 15,90  | -5,84  | 9,58    | 24,59   | 0,61     | 21,66    | 51,30    |
| IBRX 100                      | 15,46  | -5,18  | 9,57    | 25,07   | 1,72     | 24,85    | 55,25    |
| IBRX 50                       | 16,21  | -5,30  | 10,24   | 25,90   | 0,92     | 19,73    | 48,77    |
| SMALL CAP                     | 16,64  | -7,60  | 7,78    | 33,38   | 4,09     | 49,24    | 69,17    |
| IFIX                          | 1,51   | -12,17 | 0,95    | 5,68    | -2,83    | 22,09    | 26,91    |
| Índice Consumo - ICON         | 8,93   | -3,98  | 1,63    | 18,62   | 3,72     | 48,84    | 43,97    |
| Índice Dividendos - IDIV      | 14,40  | -9,12  | 9,82    | 21,30   | -0,05    | 32,77    | 60,52    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,89   | 3,13   | 2,41    | 3,29    | 4,31     | 7,73     | 12,09    |
| INPC                          | 0,95   | 3,93   | 2,73    | 3,87    | 5,20     | 8,74     | 12,61    |
| IGPM                          | 3,28   | 21,97  | 11,24   | 18,66   | 24,52    | 29,46    | 41,99    |
| SELIC                         | 0,15   | 2,59   | 0,46    | 1,03    | 2,97     | 9,24     | 16,31    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data       | Ativo                             | Aplicação  | Resgate      | Quantidade       | Valor Cota   |
|-----|------------|-----------------------------------|------------|--------------|------------------|--------------|
| 553 | 03/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 100.000,00   | 47.373,78393000  | 2,1108721260 |
| 576 | 04/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 80.832,02  | 0,00         | 23.585,55830000  | 3,4271828000 |
| 539 | 04/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 777,24     | 0,00         | 368,18888600     | 2,1109816940 |
| 561 | 05/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 40.386,77  | 0,00         | 19.130,98514900  | 2,1110658800 |
| 554 | 05/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 20.377,57    | 9.652,73997000   | 2,1110658800 |
| 566 | 05/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 784.970,52   | 229.024,51150000 | 3,4274520000 |
| 578 | 05/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 849,33       | 247,80210000     | 3,4274520000 |
| 540 | 05/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 23.845,44  | 0,00         | 11.295,45042900  | 2,1110658800 |
| 555 | 06/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 77.391,96    | 36.660,19918000  | 2,1110621800 |
| 579 | 06/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 24.590,98    | 7.174,47560000   | 3,4275648000 |
| 544 | 06/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 69.270,65    | 32.813,17369800  | 2,1110621800 |
| 556 | 09/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 99,00        | 46,89460300      | 2,1111171420 |
| 551 | 09/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 9.832,29   | 0,00         | 4.657,38722100   | 2,1111171420 |
| 580 | 09/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 5.023,50     | 1.465,54920000   | 3,4277252000 |
| 567 | 09/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 809.462,39   | 236.151,48320000 | 3,4277252000 |
| 545 | 09/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 159,54       | 75,57136300      | 2,1111171420 |
| 569 | 10/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 584.322,76   | 170.461,63150000 | 3,4278844000 |
| 568 | 10/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 72.095,50    | 21.032,06920000  | 3,4278844000 |
| 570 | 10/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 1.303.694,79 | 380.320,52360000 | 3,4278844000 |
| 581 | 10/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 539,98       | 157,52570000     | 3,4278844000 |
| 541 | 10/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 456.669,94 | 0,00         | 216.315,06200800 | 2,1111333430 |
| 571 | 11/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 112.332,70   | 32.768,25370000  | 3,4280954000 |
| 562 | 12/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 20.702,62    | 9.806,43917400   | 2,1111251120 |
| 563 | 12/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 650.000,00   | 307.892,69489800 | 2,1111251120 |
| 557 | 12/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 53.898,53    | 25.530,71331200  | 2,1111251120 |
| 582 | 12/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 22,47        | 6,55450000       | 3,4281359000 |
| 546 | 12/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00       | 48.958,12    | 23.190,53462100  | 2,1111251120 |
| 583 | 13/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00       | 12.979,08    | 3.785,95270000   | 3,4282203000 |

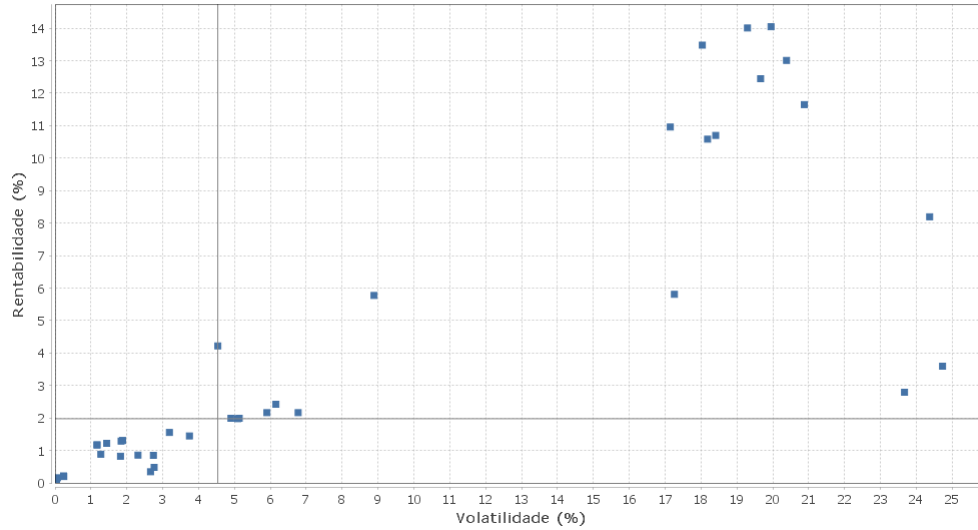
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR          | Data       | Ativo                             | Aplicação     | Resgate      | Quantidade         | Valor Cota   |
|--------------|------------|-----------------------------------|---------------|--------------|--------------------|--------------|
| 572          | 13/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 557.547,09   | 162.634,55700000   | 3,4282203000 |
| 547          | 13/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00          | 2.000.000,00 | 947.334,06443800   | 2,1111876740 |
| 573          | 16/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 3.249,19     | 947,72960000       | 3,4283933000 |
| 584          | 16/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 650,00       | 189,59310000       | 3,4283933000 |
| 542          | 16/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 79.607,00     | 0,00         | 37.705,62565200    | 2,1112764640 |
| 550          | 16/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 108.935,89    | 0,00         | 51.597,16970100    | 2,1112764640 |
| 538          | 16/11/2020 | BB PREV RF IPCA                   | 0,00          | 79.607,00    | 32.891,48616000    | 2,4202919750 |
| 549          | 16/11/2020 | BB PREV RF IPCA                   | 0,00          | 108.935,89   | 45.009,40015700    | 2,4202919750 |
| 591          | 16/11/2020 | QUELUZ VALOR FI EM ACOES          | 2.000.000,00  | 0,00         | 684.320,56326150   | 2,9226069000 |
| 585          | 17/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 5.700,00     | 1.662,49100000     | 3,4285900000 |
| 558          | 19/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00          | 150.000,00   | 71.038,82089600    | 2,1115215330 |
| 574          | 19/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 6.736,71     | 1.964,55020000     | 3,4291360000 |
| 577          | 24/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 132.164,53    | 0,00         | 38.532,34290000    | 3,4299635000 |
| 575          | 24/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 22,49        | 6,55690000         | 3,4299635000 |
| 586          | 25/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 22.424,24    | 6.537,25720000     | 3,4302219000 |
| 587          | 25/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 59.657,27    | 17.391,66490000    | 3,4302219000 |
| 543          | 25/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 11.468.143,83 | 0,00         | 5.430.410,69107000 | 2,1118372960 |
| 559          | 26/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00          | 36.064,37    | 17.076,69678600    | 2,1119055080 |
| 588          | 26/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 6.276,41     | 1.829,63260000     | 3,4304208000 |
| 560          | 27/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00          | 102.372,86   | 48.472,67243200    | 2,1119706190 |
| 548          | 27/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 0,00          | 91.926,09    | 43.526,21630900    | 2,1119706190 |
| 564          | 30/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 2.700.000,00  | 0,00         | 1.278.366,81764200 | 2,1120698400 |
| 552          | 30/11/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC              | 3.674,75      | 0,00         | 1.739,88091200     | 2,1120698400 |
| 565          | 30/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 4.400.000,00  | 0,00         | 1.282.431,49010000 | 3,4309825000 |
| 589          | 30/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 14.973,70    | 4.364,26070000     | 3,4309825000 |
| 590          | 30/11/2020 | BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO | 0,00          | 30.894,08    | 9.004,44110000     | 3,4309825000 |
| <b>Total</b> |            |                                   |               |              |                    |              |

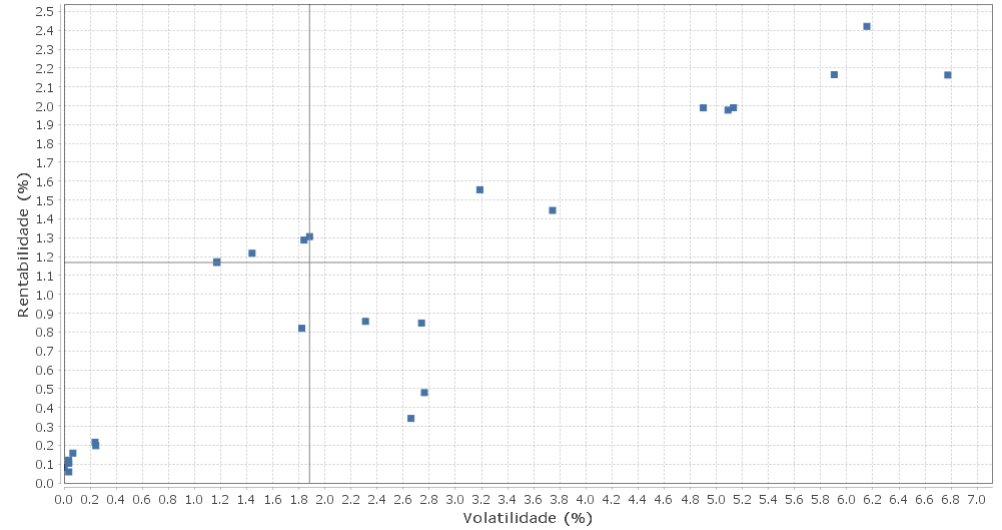
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

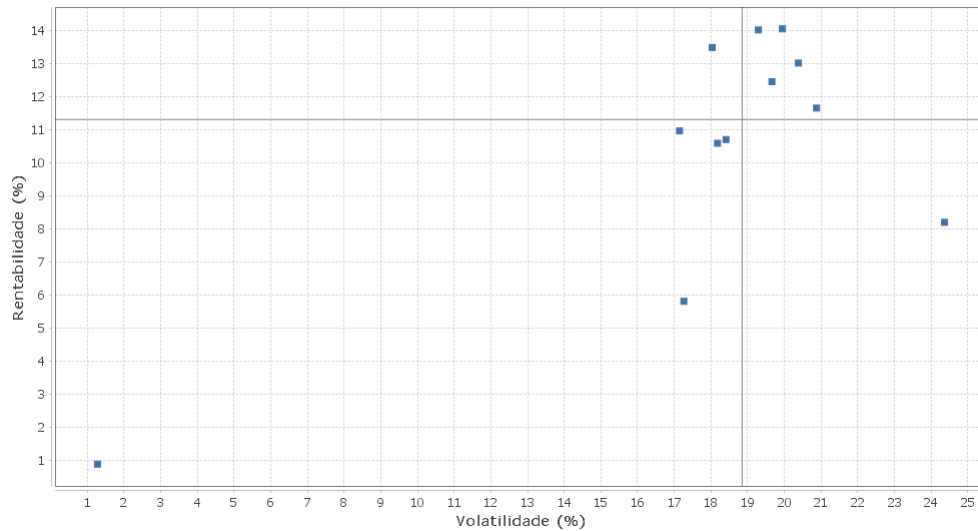
GUARULHOS - CONSOLIDADO - No Mês



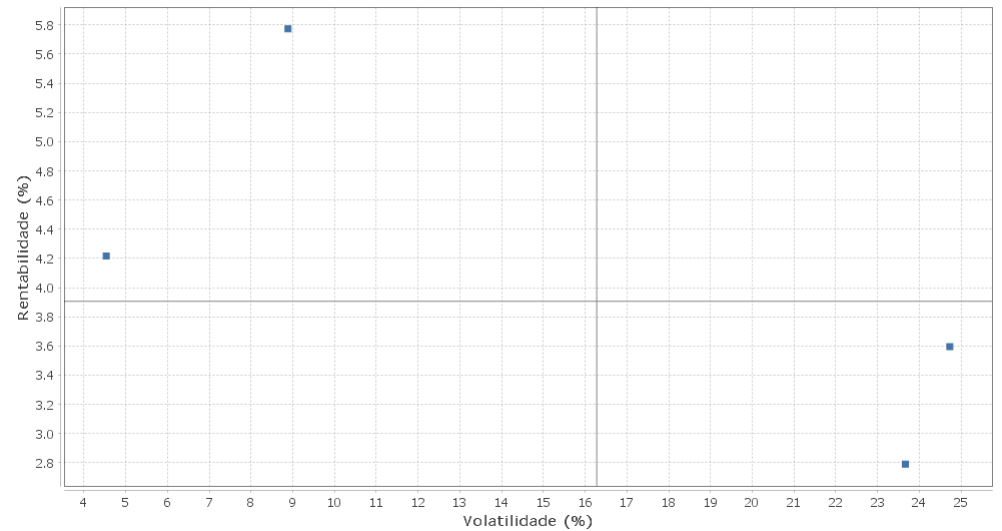
Renda Fixa - No Mês



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\$): 12.045.601,67

Value-At-Risk: 2,91%

| Ativo   | Estratégia              | Volatilidade | VaR  | CVaR | Sharpe  | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-------------------------|--------------|------|------|---------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF                       | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,00         | 0,00 | 0,00 | -123,29 | 0,08  | 96.596,31     | 0,02       |
| BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO                         | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,04         | 0,14 | 0,00 | -0,82   | 0,12  | 7.121.617,40  | 1,72       |
| BB PREV RF FLUXO FIC                                      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,04         | 0,05 | 0,00 | -2,51   | 0,06  | 19.905.560,24 | 4,82       |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI             | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,04         | 0,30 | 0,01 | -1,23   | 0,10  | 11.802.605,64 | 2,86       |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                        | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,07         | 0,09 | 0,00 | 0,12    | 0,16  | 4.660.379,72  | 1,13       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF               | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,24         | 0,16 | 0,00 | 0,28    | 0,22  | 12.608.655,22 | 3,05       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                 | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,24         | 0,17 | 0,00 | 0,20    | 0,20  | 12.541.689,27 | 3,03       |
| BB PREV RF VII  | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,17         | 0,90 | 0,00 | 0,87    | 1,17  | 352.362,82    | 0,09       |
| BB PREVIDENCIÁRIO XI TP                                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,17         | 0,94 | 0,01 | 0,87    | 1,17  | 6.739.942,40  | 1,63       |
| MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO                            | Artigo 8º III           | 1,28         | 0,80 | 0,00 | 0,58    | 0,88  | 3.026.512,85  | 0,73       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,44         | 1,07 | 0,01 | 0,74    | 1,22  | 6.979.748,58  | 1,69       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF              | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,82         | 1,23 | 0,08 | 0,37    | 0,82  | 36.266.793,77 | 8,78       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP            | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,84         | 1,03 | 0,01 | 0,62    | 1,29  | 3.872.379,00  | 0,94       |
| BB PREV RF IPCA   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,88         | 1,42 | 0,01 | 0,61    | 1,31  | 7.461.875,51  | 1,81       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL                    | Artigo 7º IV, Alínea a  | 2,31         | 1,14 | 0,02 | 0,31    | 0,86  | 10.377.305,19 | 2,51       |
| BB PREV RF IRF-M  | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,66         | 1,34 | 0,03 | 0,07    | 0,34  | 11.722.843,09 | 2,84       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                          | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,74         | 1,33 | 0,03 | 0,25    | 0,85  | 13.295.359,79 | 3,22       |
| BRADESCO FI RF IDKA PRE 2                                 | Artigo 7º IV, Alínea a  | 2,76         | 1,43 | 0,05 | 0,12    | 0,48  | 22.506.768,69 | 5,45       |
| FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF                | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,19         | 1,70 | 0,01 | 0,44    | 1,55  | 4.293.535,00  | 1,04       |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                          | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,75         | 1,80 | 0,06 | 0,35    | 1,44  | 20.211.422,32 | 4,89       |
| ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR | Artigo 9º A, II         | 4,53         | 1,91 | 0,00 | 0,90    | 4,22  | 2.469.557,50  | 0,60       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,90         | 2,67 | 0,04 | 0,38    | 1,99  | 9.087.373,16  | 2,20       |
| BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF                                | Artigo 7º IV, Alínea a  | 5,09         | 2,80 | 0,01 | 0,36    | 1,98  | 2.987.473,76  | 0,72       |
| MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP       | Artigo 7º III, Alínea a | 5,13         | 2,77 | 0,03 | 0,36    | 1,99  | 5.974.536,42  | 1,45       |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF                          | Artigo 7º I, Alínea b   | 5,90         | 3,30 | 0,09 | 0,34    | 2,16  | 16.337.078,78 | 3,95       |
| CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF              | Artigo 7º I, Alínea b   | 6,15         | 2,82 | 0,04 | 0,37    | 2,42  | 7.330.800,08  | 1,77       |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF                           | Artigo 7º IV, Alínea a  | 6,77         | 3,56 | 0,18 | 0,30    | 2,16  | 29.022.468,85 | 7,02       |
| WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM                   | Artigo 9º A, II         | 8,89         | 2,97 | 0,02 | 0,63    | 5,77  | 9.522.695,46  | 2,30       |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo   | Estratégia             | Volatilidade | VaR   | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|-------|------|--------|-------|---------------|------------|
| INVESTIMENTO NO EXTERIOR  |                        |              |       |      |        |       |               |            |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA                                      | Artigo 8º II, Alínea a | 17,14        | 9,28  | 0,35 | 0,63   | 10,96 | 16.380.474,32 | 3,96       |
| RBBV11  | Artigo 8º IV, Alínea b | 17,26        | 0,12  | 0,00 | 0,33   | 5,81  | 1.404.000,00  | 0,34       |
| CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES                                 | Artigo 8º II, Alínea a | 18,03        | 9,16  | 0,09 | 0,74   | 13,48 | 4.291.688,24  | 1,04       |
| SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO                                | Artigo 8º III          | 18,18        | 8,25  | 0,29 | 0,57   | 10,58 | 21.183.739,90 | 5,13       |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO                        | Artigo 8º III          | 18,41        | 8,37  | 0,08 | 0,57   | 10,70 | 5.945.796,13  | 1,44       |
| CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA                                       | Artigo 8º II, Alínea a | 19,29        | 9,90  | 0,26 | 0,72   | 14,01 | 11.925.578,83 | 2,89       |
| QUELUZ VALOR FI EM ACOES  | Artigo 8º II, Alínea a | 19,66        | 11,28 | 0,05 | 0,63   | 12,45 | 2.054.303,78  | 0,50       |
| VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES                                  | Artigo 8º II, Alínea a | 19,95        | 9,50  | 0,27 | 0,70   | 14,05 | 13.028.434,27 | 3,15       |
| VINCI MOSAICO FIA   | Artigo 8º II, Alínea a | 20,38        | 11,88 | 0,29 | 0,63   | 13,01 | 11.110.974,20 | 2,69       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA                           | Artigo 8º II, Alínea a | 20,88        | 11,83 | 0,34 | 0,55   | 11,65 | 13.164.385,21 | 3,19       |
| ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR               | Artigo 9º A, II        | 23,67        | 12,12 | 0,04 | 0,11   | 2,79  | 4.248.826,57  | 1,03       |
| BRDESCO F I A SELECTION   | Artigo 8º II, Alínea a | 24,37        | 10,95 | 0,07 | 0,33   | 8,19  | 2.820.433,99  | 0,68       |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | Artigo 9º A, II        | 24,73        | 14,63 | 0,01 | 0,14   | 3,60  | 7.145.487,50  | 1,73       |