



**IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO**  
JULHO 2020  
**SANTO**



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 20.08.2020.

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

**RENTA FIXA** **83,94%**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

| Emissor                                | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)             | % Carteira   |
|----------------------------------------|----------------|---------------------|-----------------|-----------------|-------------------------|--------------|
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150820   | 1,20                | 0,09            | 0,94            | 34.038.312,54           | 0,70         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150830   | 13,55               | 4,24            | 5,17            | 120.817.280,50          | 2,50         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150822   | 4,98                | 0,81            | 4,32            | 414.870.281,65          | 8,57         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150523   | 6,05                | 1,14            | 5,32            | 76.701.989,40           | 1,58         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150521   | 2,17                | 0,32            | 2,27            | 316.412.683,83          | 6,54         |
| TESOURO NACIONAL                       | LFT 010324     | 0,07                | 0,20            | 1,91            | 111.964.537,48          | 2,31         |
| TESOURO NACIONAL                       | LFT 010921     | 0,07                | 0,20            | 1,94            | 246.718.453,70          | 5,10         |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b> |                | <b>3,42</b>         | <b>0,83</b>     | <b>3,21</b>     | <b>1.321.523.539,10</b> | <b>27,30</b> |

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                               | 5,87                | 1,13            | 5,86            | 50.453.656,18  | 1,04       | 5.350.645.859,80  | 0,94    |
| BRB      | BRB      | 35-BRB MILLENIUM                               | 0,08                | 0,15            | 1,61            | 1.388.390,66   | 0,03       | 62.031.608,79     | 2,24    |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B            | 22,79               | 7,49            | -1,55           | 35.904.427,40  | 0,74       | 336.367.162,90    | 10,67   |
| BB       | BB       | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 0,54                | 0,23            | 2,69            | 303.546.953,68 | 6,27       | 7.835.713.656,67  | 3,87    |
| BB       | BB       | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI           | 12,47               | 4,36            | 2,54            | 14.047.456,88  | 0,29       | 5.823.784.558,48  | 0,24    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 12,54               | 4,38            | 2,42            | 14.200.588,04  | 0,29       | 6.313.416.954,01  | 0,22    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 0,53                | 0,24            | 2,73            | 40.306.177,05  | 0,83       | 10.907.406.871,77 | 0,37    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,95                | 0,97            | 4,05            | 34.592.084,86  | 0,71       | 12.027.903.790,65 | 0,29    |
| BB       | BB       | BB PREV RF IDKA2                               | 4,11                | 0,81            | 3,71            | 29.449.682,27  | 0,61       | 6.099.396.938,17  | 0,48    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                 | Admin.   | Ativo                                               | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)             | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|----------------------------------------|----------|-----------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|--------------|-------------------|---------|
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              | 19,21                  | 7,28               | 1,51               | 7.854.983,90            | 0,16         | 2.088.485.812,29  | 0,38    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 19,32                  | 7,29               | 1,46               | 11.220.418,59           | 0,23         | 2.059.270.796,72  | 0,54    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO                     | 8,70                   | 1,50               | 7,47               | 21.260.740,14           | 0,44         | 3.049.933.927,01  | 0,70    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 4,02                   | 0,83               | 3,97               | 32.943.267,65           | 0,68         | 7.954.778.997,85  | 0,41    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 5,85                   | 1,09               | 5,87               | 37.149.945,22           | 0,77         | 15.544.114.121,31 | 0,24    |
| BANESTES                               | BANESTES | BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                   | 4,17                   | 0,67               | 5,55               | 1.414.423,24            | 0,03         | 179.782.214,33    | 0,79    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 6,08                   | 1,77               | 3,55               | 668.181.616,89          | 13,80        | 10.799.663.748,52 | 6,19    |
| CEF                                    | CEF      | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 5,95                   | 0,98               | 5,65               | 701.033.789,50          | 14,48        | 12.451.209.797,34 | 5,63    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |          |                                                     | <b>5,01</b>            | <b>1,33</b>        | <b>4,10</b>        | <b>2.004.948.602,15</b> | <b>41,41</b> |                   |         |

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

| Gestor                                   | Admin. | Ativo                                             | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|------------------------------------------|--------|---------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------|------------------|---------|
| CEF                                      | CEF    | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 12,47                  | 4,40               | 2,46               | 2.094.982,57        | 0,04        | 2.998.036.270,63 | 0,07    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |                                                   | <b>12,47</b>           | <b>4,40</b>        | <b>2,46</b>        | <b>2.094.982,57</b> | <b>0,04</b> |                  |         |

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

| Gestor   | Admin.   | Ativo                                            | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)    | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|----------|----------|--------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------|------------|------------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,07                   | 0,10               | 0,27               | 6.558.893,01   | 0,14       | 96.769.839,70    | 6,78    |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI     | 0,99                   | 0,55               | -1,09              | 8.668.825,91   | 0,18       | 316.989.364,17   | 2,73    |
| BRB      | BRB      | 33-BRB TESOURO                                   | 0,08                   | 0,09               | 1,27               | 5.738,98       | 0,00       | 282.759.728,99   | 0,00    |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,06                   | 0,02               | 0,40               | 52.210.413,20  | 1,08       | 824.188.882,05   | 6,33    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,29                   | 0,25               | 1,62               | 129.939.525,99 | 2,68       | 4.665.137.027,34 | 2,79    |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                     | 25,96                  | 6,59               | -2,31              | 33.410.699,15  | 0,69       | 311.642.335,02   | 10,72   |
| BB       | BB       | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | 0,17                   | 0,24               | 1,61               | 327.393.523,00 | 6,76       | 2.412.408.451,26 | 13,57   |
| BB       | BB       | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,07                   | 0,10               | 1,35               | 416.495,75     | 0,01       | 1.725.378.039,09 | 0,02    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 0,07                   | 0,13               | 0,72               | 161,91         | 0,00       | 506.083.614,11   | 0,00    |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI          | 0,92                   | 0,61               | -0,94              | 169.770.705,11 | 3,51       | 1.958.639.802,94 | 8,67    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                  | Admin.   | Ativo                            | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo    | % Fundo |
|-----------------------------------------|----------|----------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF | 2,54                   | 1,86               | 0,53               | 7.264.591,70          | 0,15         | 182.307.109,20 | 3,98    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |          |                                  | <b>1,28</b>            | <b>0,59</b>        | <b>0,43</b>        | <b>735.639.573,71</b> | <b>15,19</b> |                |         |
| Renda Fixa                              |          |                                  | 3,63                   | 1,03               | 3,14               | 4.064.206.697,53      | 83,94        |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,81%

#### 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 |
|---------------------------------|--------|-------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------|------------|----------------|---------|
| CEF                             | CEF    | FIA BRASIL IBX-50             | 44,84               | 8,20            | -11,75          | 150.013.619,72 | 3,10       | 978.968.730,39 | 15,32   |
| BB                              | BB     | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI        | 44,20               | 8,44            | -10,49          | 102.280.605,46 | 2,11       | 912.996.606,09 | 11,20   |
| CEF                             | CEF    | FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA | 42,71               | 8,08            | -11,06          | 9.466.946,58   | 0,20       | 118.687.515,39 | 7,98    |
| CEF                             | CEF    | FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA     | 43,54               | 8,14            | -11,05          | 54.856.052,35  | 1,13       | 692.799.908,03 | 7,92    |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a |        |                               | 44,29               | 8,26            | -11,29          | 316.617.224,11 | 6,54       |                |         |

#### 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 |
|----------------------------------|----------|--------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------|------------|------------------|---------|
| BB                               | BB       | BB AÇÕES DIVIDENDOS                                    | 38,20               | 6,77            | -17,03          | 127.513.534,40 | 2,63       | 972.576.793,16   | 13,11   |
| VINCI                            | CEF      | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS         | 39,01               | 8,32            | -9,87           | 30.794.220,98  | 0,64       | 862.156.434,48   | 3,57    |
| CEF                              | CEF      | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                             | 47,49               | 9,27            | -14,17          | 151.890.163,53 | 3,14       | 1.227.996.315,01 | 12,37   |
| BANESTES                         | BANESTES | BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 45,00               | 8,36            | -0,70           | 5.490.161,59   | 0,11       | 154.315.606,33   | 3,56    |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a |          |                                                        | 42,21               | 8,14            | -14,43          | 315.688.080,50 | 6,52       |                  |         |

#### Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

| Gestor                           | Admin. | Ativo            | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)  | % Carteira | PL do Fundo    | % Fundo |
|----------------------------------|--------|------------------|---------------------|-----------------|-----------------|--------------|------------|----------------|---------|
| CEF                              | CEF    | FIP CAIXA CYRELA | 26,54               | -3,16           | -10,03          | 1.642.611,83 | 0,03       | 150.839.883,53 | 1,09    |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a |        |                  | 26,54               | -3,16           | -10,03          | 1.642.611,83 | 0,03       |                |         |

#### 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 |
|----------------------------------|--------|------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------|----------------|---------|
| CEF                              | CEF    | CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII | 42,67               | 12,35           | 16,11           | 34.600.000,00 | 0,71       | 153.845.967,38 | 22,49   |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b |        |                              | 42,67               | 12,35           | 24,59           | 34.600.000,00 | 0,71       |                |         |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

40,34

8,37

-11,02

668.547.916,44

13,81

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,25%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

| Gestor                            | Admin. | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|----------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|-------------|------------------|---------|
| CEF                               | CEF    | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I    | 26,66                  | 1,88               | 35,34              | 87.319.733,33         | 1,80        | 1.279.266.331,34 | 6,83    |
| BB                                | BB     | BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I | 26,48                  | 0,98               | 30,58              | 21.483.110,71         | 0,44        | 276.723.998,51   | 7,76    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, III</b> |        |                                        | <b>26,50</b>           | <b>1,70</b>        | <b>34,37</b>       | <b>108.802.844,04</b> | <b>2,25</b> |                  |         |
| Investimentos no Exterior         |        |                                        | 26,50                  | 1,70               | 34,37              | 108.802.844,04        | 2,25        |                  |         |
| Total                             |        |                                        |                        |                    |                    | 4.841.557.458,01      | 100,00      |                  |         |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

| Política de Investimentos                   |                                                   |                  |            |        |          |        |              |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------|------------|--------|----------|--------|--------------|
| Artigo                                      | Tipo de Ativo                                     | Valor(R\$)       | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa                                  |                                                   |                  |            |        |          |        |              |
| Artigo 7º I, Alínea a                       | Títulos do Tesouro Nacional                       | 1.321.523.539,10 | 27,30      | 20,00  | 27,00    | 60,00  | 100,00       |
| Artigo 7º I, Alínea b                       | Fundos 100% Títulos Públicos                      | 2.004.948.602,15 | 41,41      | 15,00  | 36,30    | 60,00  | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                     | Fundos Renda Fixa Referenciados                   | 2.094.982,57     | 0,04       | 0,00   | 0,10     | 2,00   | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 735.639.573,71   | 15,19      | 5,00   | 10,00    | 40,00  | 40,00        |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 4.064.206.697,53 | 83,94      |        |          |        |              |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                  |            |        |          |        |              |
| Artigo 8º I, Alínea a                       | Fundos de Ações Referenciados                     | 316.617.224,11   | 6,54       | 0,00   | 6,00     | 30,00  | 30,00        |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 315.688.080,50   | 6,52       | 0,00   | 5,00     | 20,00  | 20,00        |
| Artigo 8º IV, Alínea a                      | Fundos de Participações                           | 1.642.611,83     | 0,03       | 0,00   | 0,10     | 2,00   | 5,00         |
| Artigo 8º IV, Alínea b                      | Fundos de Investimentos Imobiliários              | 34.600.000,00    | 0,71       | 0,00   | 0,50     | 5,00   | 5,00         |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 668.547.916,44   | 13,81      |        |          |        |              |
| Investimentos no Exterior                   |                                                   |                  |            |        |          |        |              |
| Artigo 9º A, III                            | Ações - BDR Nível I                               | 108.802.844,04   | 2,25       | 0,00   | 4,00     | 5,00   | 10,00        |
|                                             | Total Investimentos no Exterior                   | 108.802.844,04   | 2,25       |        |          |        |              |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

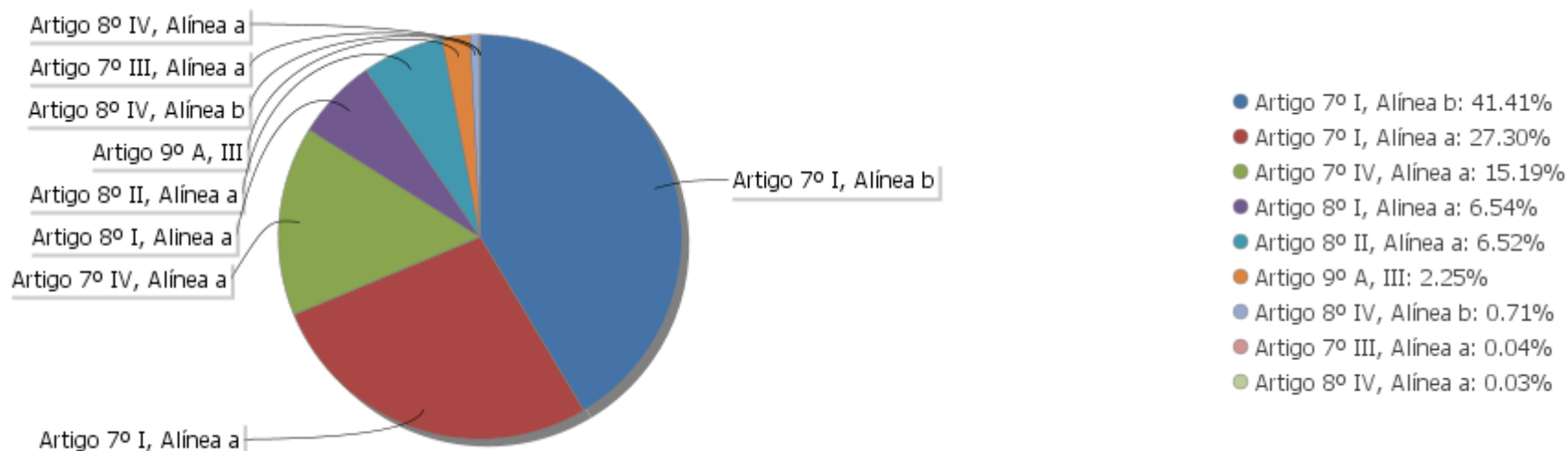
| Estratégia Indexador                         | No Mês           | No Ano            | 3 meses          | 6 meses           | 12 meses          | No Mês(R\$)   | No Ano(R\$)    |
|----------------------------------------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|---------------|----------------|
| Artigo 7º I, Alínea a<br>% do CDI            | 0,83<br>424,99   | 3,21<br>164,48    | 3,15<br>489,16   | 2,67<br>170,42    | 7,11<br>168,75    | 10.825.437,94 | 41.257.263,73  |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | 1,33<br>685,09   | 4,10<br>209,98    | 3,31<br>514,12   | 3,51<br>223,61    | 7,52<br>178,49    | 26.345.252,37 | 83.056.716,47  |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | 4,40<br>2.262,18 | 2,46<br>125,96    | 8,09<br>1.256,98 | 2,22<br>141,71    | 7,80<br>185,00    | 88.223,11     | 50.277,05      |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 0,59<br>306,02   | 0,43<br>21,94     | 1,26<br>196,07   | 0,05<br>3,35      | 2,77<br>65,82     | 4.301.026,46  | 3.797.562,02   |
| Artigo 8º I, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p.  | 8,26<br>-0,00    | -11,29<br>-0,28   | 28,35<br>0,52    | -9,89<br>-0,36    | 1,06<br>-0,02     | 24.163.911,07 | -43.704.652,39 |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 8,14<br>-0,13    | -14,43<br>-3,42   | 24,34<br>-3,50   | -14,84<br>-5,30   | 0,60<br>-0,48     | 23.762.686,79 | -55.051.500,05 |
| Artigo 8º IV, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -3,16<br>-11,43  | -10,03<br>0,98    | -18,31<br>-46,14 | -14,20<br>-4,66   | -20,53<br>-21,61  | -4.235,29     | -247.757,92    |
| Artigo 8º IV, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | 12,35<br>4,08    | 24,59<br>35,60    | 41,97<br>14,14   | 3,27<br>12,81     | 79,58<br>78,50    | 3.842.800,00  | 6.933.000,00   |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | 1,70<br>873,19   | 34,37<br>1.760,55 | 8,54<br>1.326,82 | 26,95<br>1.717,26 | 54,03<br>1.281,92 | 1.815.521,22  | 26.199.312,46  |
|                                              |                  |                   |                  |                   |                   | 95.140.623,67 | 62.290.221,37  |

### Análise de Liquidez

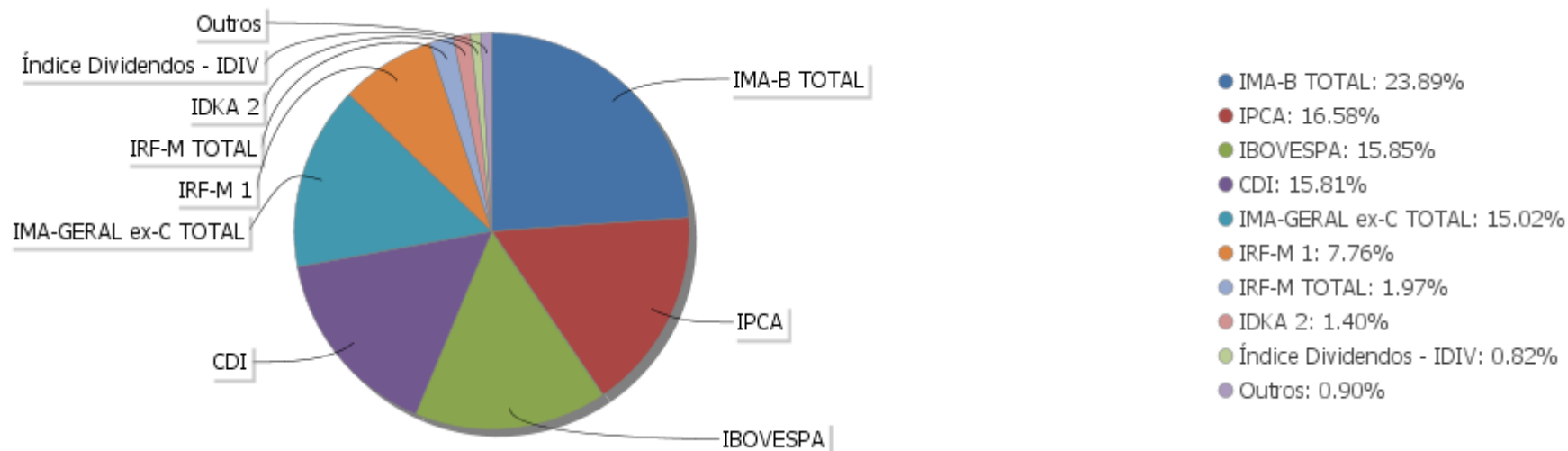
| Período           | Valor (R\$)      | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|------------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 3.517.787.848,88 | 72,66 | 3.517.787.848,88      | 72,66     |
| de 31 a 364 dias  | 352.697.066,40   | 7,28  | 3.870.484.915,28      | 79,94     |
| acima de 365 dias | 971.072.542,73   | 20,06 | 4.841.557.458,01      | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

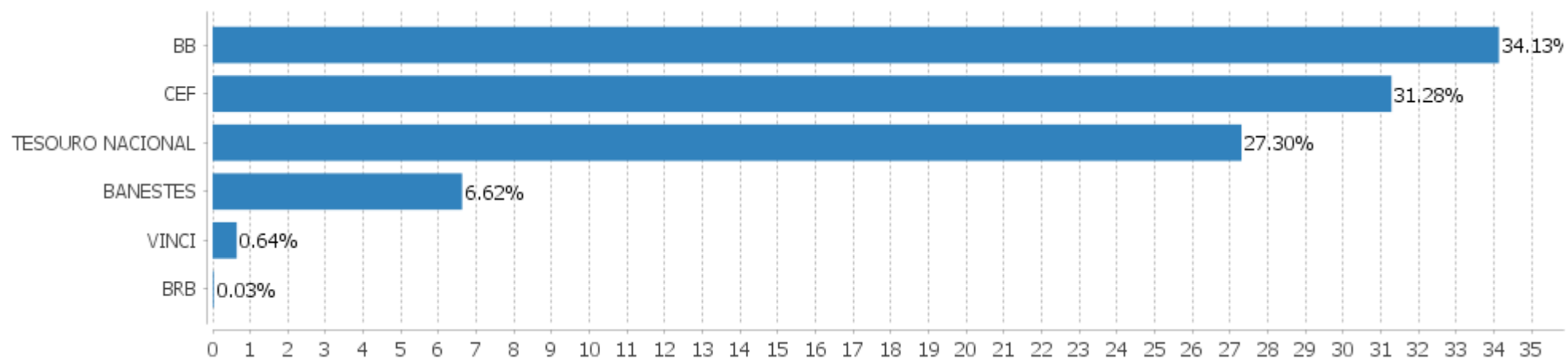


### Alocação Por Estratégia



## 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           | 0,42  | -0,92 | -5,48 | 1,81  | 1,71  | 1,96  | 2,00  |       |       |       |       |       | 1,27     |
| IPCA + 5%      | 0,64  | 0,60  | 0,50  | 0,08  | 0,01  | 0,67  | 0,81  |       |       |       |       |       | 3,34     |
| p.p. indexador | -0,22 | -1,52 | -5,98 | 1,74  | 1,70  | 1,29  | 1,19  |       |       |       |       |       | -2,07    |
| 2019           | 1,69  | 0,49  | 0,60  | 0,91  | 1,51  | 1,74  | 1,03  | 0,23  | 1,43  | 1,33  | -0,10 | 1,02  | 12,53    |
| IPCA + 5,5%    | 0,79  | 0,86  | 1,16  | 1,02  | 0,60  | 0,41  | 0,68  | 0,58  | 0,41  | 0,59  | 0,94  | 1,60  | 10,07    |
| p.p. indexador | 0,90  | -0,37 | -0,55 | -0,11 | 0,91  | 1,32  | 0,35  | -0,35 | 1,03  | 0,74  | -1,04 | -0,58 | 2,46     |
| 2018           | 1,29  | 0,58  | 1,11  | 0,44  | -1,02 | -0,00 | 1,12  | 0,18  | 0,62  | 1,87  | 0,52  | 0,84  | 7,80     |
| IPCA + 5,75%   | 0,78  | 0,72  | 0,56  | 0,69  | 0,87  | 1,73  | 0,82  | 0,42  | 0,90  | 0,94  | 0,23  | 0,60  | 9,66     |
| p.p. indexador | 0,51  | -0,14 | 0,56  | -0,25 | -1,89 | -1,73 | 0,30  | -0,24 | -0,29 | 0,92  | 0,29  | 0,25  | -1,86    |
| 2017           | 1,30  | 1,89  | 1,24  | 0,45  | 0,35  | 0,70  | 2,20  | 1,13  | 1,07  | 0,43  | 0,19  | 0,82  | 12,40    |
| 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 | 0,41  | 1,15  | 0,45  | -0,11 | -0,47 | 0,45  | 1,48  | 0,40  | 0,44  | -0,48 | -0,55 | -0,09 | 3,35     |
| 2016           | 1,92  | 1,40  | 1,66  | 1,65  | 0,93  | 1,19  | 1,45  | 1,23  | 1,28  | 0,82  | 0,38  | 1,47  | 16,48    |
| IPCA + 6%      | 1,74  | 1,34  | 0,94  | 1,08  | 1,27  | 0,86  | 1,01  | 0,98  | 0,57  | 0,72  | 0,64  | 0,81  | 12,64    |
| p.p. indexador | 0,18  | 0,05  | 0,72  | 0,57  | -0,34 | 0,33  | 0,44  | 0,26  | 0,71  | 0,10  | -0,26 | 0,66  | 3,84     |
| 2015           | 1,51  | 0,80  | 0,65  | 1,24  | 1,39  | 0,73  | 1,09  | -0,17 | 0,72  | 1,96  | 0,91  | 1,67  | 13,20    |
| IPCA + 6%      | 1,73  | 1,64  | 1,84  | 1,18  | 1,21  | 1,28  | 1,16  | 0,71  | 1,03  | 1,31  | 1,48  | 1,47  | 17,26    |
| p.p. indexador | -0,22 | -0,85 | -1,19 | 0,06  | 0,19  | -0,55 | -0,07 | -0,88 | -0,31 | 0,64  | -0,56 | 0,19  | -4,06    |
| 2014           | -1,15 | 2,71  | 0,90  | 1,75  | 2,50  | 0,76  | 1,06  | 2,33  | -0,76 | 1,18  | 0,88  | 0,18  | 12,97    |
| IPCA + 6%      | 1,06  | 1,16  | 1,36  | 1,14  | 0,95  | 0,87  | 0,54  | 0,74  | 1,08  | 0,96  | 0,98  | 1,29  | 12,82    |
| p.p. indexador | -2,21 | 1,56  | -0,46 | 0,61  | 1,55  | -0,11 | 0,52  | 1,59  | -1,84 | 0,22  | -0,09 | -1,12 | 0,15     |
| 2013           | 0,58  | -0,48 | -0,65 | 1,00  | -1,62 | -1,42 | 0,81  | -0,81 | 0,75  | 0,72  | -1,14 | 0,87  | -1,43    |
| IPCA + 6%      | 1,37  | 1,02  | 0,94  | 1,06  | 0,86  | 0,72  | 0,56  | 0,75  | 0,84  | 1,11  | 1,01  | 1,41  | 12,29    |
| p.p. indexador | -0,80 | -1,50 | -1,58 | -0,07 | -2,48 | -2,15 | 0,25  | -1,56 | -0,08 | -0,38 | -2,14 | -0,54 | -13,72   |
| 2012           | 1,48  | 1,67  | 1,59  | 3,31  | 1,29  | -0,23 | 2,31  | 1,35  | 1,11  | 2,72  | 0,68  | 1,57  | 20,51    |
| IPCA + 6%      | 1,07  | 0,89  | 0,72  | 1,11  | 0,87  | 0,54  | 0,94  | 0,95  | 1,01  | 1,10  | 1,07  | 1,26  | 12,16    |
| p.p. indexador | 0,41  | 0,78  | 0,87  | 2,20  | 0,42  | -0,77 | 1,37  | 0,41  | 0,10  | 1,61  | -0,38 | 0,31  | 8,35     |
| 2011           | 0,11  | 0,67  | 1,40  | 0,53  | 1,40  | 0,17  | 0,81  | 4,20  | 1,08  | 1,30  | 1,60  | 0,51  | 14,62    |
| IPCA + 6%      | 1,32  | 1,27  | 1,28  | 1,21  | 0,98  | 0,64  | 0,65  | 0,91  | 1,02  | 0,90  | 0,99  | 1,01  | 12,87    |
| p.p. indexador | -1,21 | -0,60 | 0,12  | -0,68 | 0,42  | -0,47 | 0,17  | 3,30  | 0,06  | 0,40  | 0,61  | -0,51 | 1,76     |

## PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

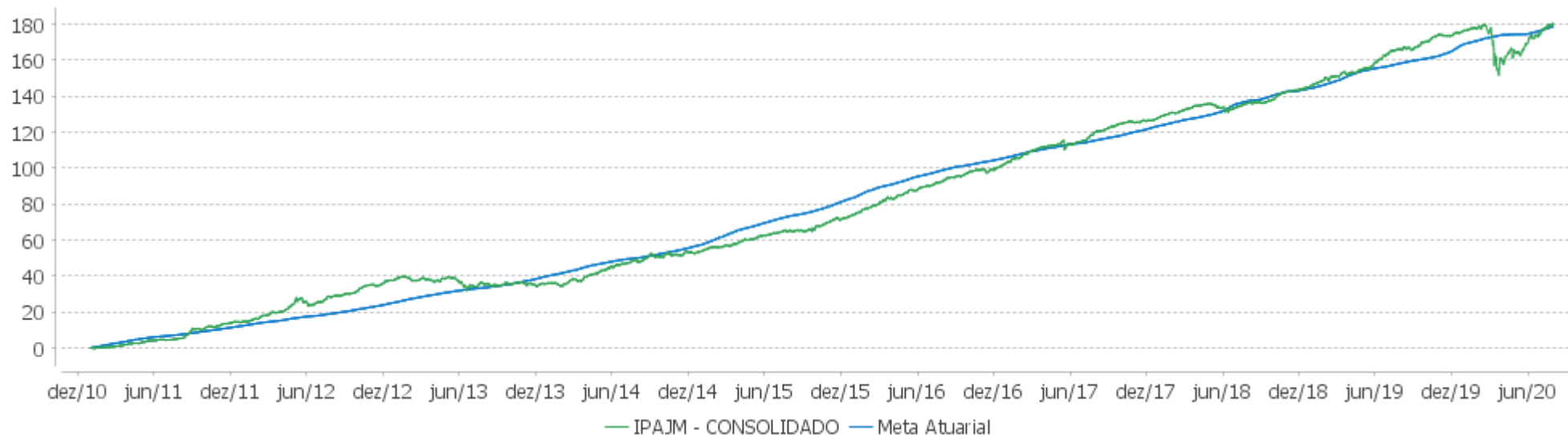
## RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

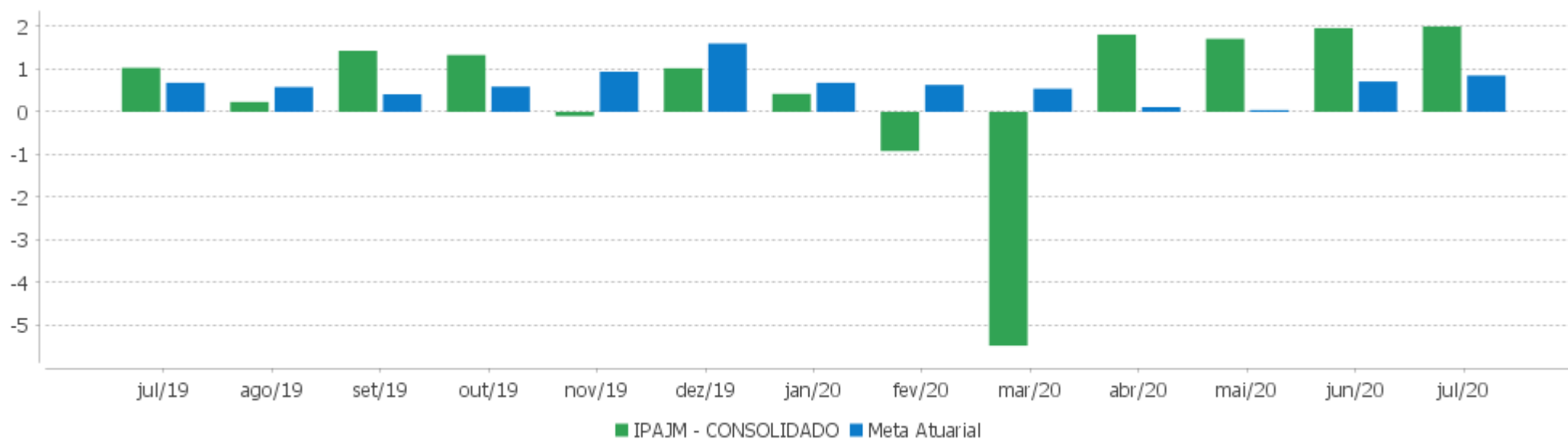
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|---------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 61            | 53,04     | 03 meses         | 5,77     | 1,49          | 4,28       | 4,01               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 54            | 46,96     | 06 meses         | 0,85     | 2,68          | -1,83      | 10,55              |
|                                 |               |           | 12 meses         | 5,28     | 7,66          | -2,38      | 7,47               |
|                                 |               |           | 24 meses         | 18,62    | 17,30         | 1,31       | 5,45               |
|                                 |               |           | 36 meses         | 27,37    | 29,68         | -2,31      | 4,61               |
|                                 |               |           | Desde 31/12/2010 | 180,06   | 188,12        | -8,06      | 3,66               |
|                                 | Rentabilidade | Mês       |                  |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,20          | 2011-08   |                  |          |               |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -5,48         | 2020-03   |                  |          |               |            |                    |

## 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       |
|-------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | 4,38<br>-0,01 | 2,42<br>-0,23  | 8,09<br>-0,05  | 2,17<br>-0,22  | 7,72<br>-0,43  | 37,07<br>-0,79 | 45,56<br>-1,19 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.     | 0,97<br>-0,02 | 4,05<br>-0,15  | 4,23<br>-0,05  | 3,48<br>-0,13  | 8,54<br>-0,29  | 23,61<br>-0,55 | 33,54<br>-0,89 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.          | 0,23<br>-0,01 | 2,69<br>-0,15  | 0,88<br>-0,06  | 2,26<br>-0,13  | 5,22<br>-0,29  | 12,65<br>-0,54 | 20,70<br>-0,86 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.   | 1,09<br>0,01  | 5,87<br>-0,13  | 3,29<br>-0,04  | 4,99<br>-0,08  | 9,54<br>-0,27  | 25,97<br>-0,62 | 35,83<br>-0,95 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.   | 7,29<br>-0,03 | 1,46<br>-0,22  | 11,43<br>-0,08 | 1,50<br>-0,14  | 7,35<br>-0,46  | 47,92<br>-1,45 | 54,33<br>-1,86 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO<br>Var. IRF-M 1+ p.p.                   | 1,50<br>0,03  | 7,47<br>-0,12  | 4,47<br>-0,03  | 6,32<br>-0,08  | 11,77<br>-0,24 | 32,19<br>-0,62 | 42,77<br>-1,01 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.            | 7,49<br>3,11  | -1,55<br>-4,20 | 10,74<br>2,60  | -2,09<br>-4,47 | 4,08<br>-4,07  | 44,21<br>6,35  | 49,90<br>3,15  |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1<br>Var. IRF-M 1 p.p.                  | 0,67<br>0,44  | 5,55<br>2,71   | 1,97<br>1,03   | 4,80<br>2,41   | 8,68<br>3,18   | 21,03<br>7,83  | 30,55<br>8,99  |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.                                    | 0,81<br>-0,13 | 3,71<br>-0,60  | 4,07<br>0,35   | 3,32<br>-0,44  | 7,99<br>-0,69  | 20,62<br>-1,75 | 30,76<br>-2,60 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.      | 1,77<br>0,11  | 3,55<br>0,15   | 3,83<br>0,26   | 3,05<br>0,17   | 7,10<br>0,02   | 23,78<br>0,51  | 32,81<br>0,56  |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.          | 0,98<br>0,62  | 5,65<br>5,19   | 3,14<br>2,90   | 4,79<br>4,54   | 9,68<br>7,38   | 28,24<br>22,64 | 37,15<br>26,81 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p. | 0,83<br>-0,11 | 3,97<br>-0,34  | 3,96<br>0,24   | 3,50<br>-0,26  | 8,10<br>-0,58  | 20,93<br>-1,44 | 31,10<br>-2,25 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | 4,36<br>-0,02 | 2,54<br>-0,11  | 8,07<br>-0,07  | 2,27<br>-0,11  | 7,94<br>-0,22  | 37,20<br>-0,66 | 45,69<br>-1,07 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.        | 0,24<br>0,00  | 2,73<br>-0,11  | 0,90<br>-0,04  | 2,30<br>-0,09  | 5,30<br>-0,21  | 12,79<br>-0,41 | 20,92<br>-0,64 |
| BB PREV RF IRF-M<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.                               | 1,13<br>0,04  | 5,86<br>-0,14  | 3,31<br>-0,01  | 4,96<br>-0,12  | 9,57<br>-0,24  | 26,04<br>-0,55 | 35,92<br>-0,87 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B 5+ p.p.            | 7,28<br>-0,05 | 1,51<br>-0,16  | 11,38<br>-0,12 | 1,46<br>-0,18  | 7,68<br>-0,13  | 48,58<br>-0,79 | 54,96<br>-1,23 |
| 35-BRB MILLENIUM                                                        | 0,15          | 1,61           | 0,52           | 1,28           | 3,72           | 9,98           | 17,01          |



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                                          | 76,56  | 82,69  | 81,30   | 81,68   | 88,34    | 92,20    | 91,10    |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI      | 0,55   | -1,09  | 1,33    | -1,43   | 1,02     | 7,23     | 14,67    |
| % do CDI                                          | 282,46 | -55,85 | 205,90  | -90,82  | 24,21    | 66,79    | 78,56    |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                      | 6,59   | -2,31  | 10,55   | -3,03   | 2,22     | 38,94    | 44,06    |
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | 2,20   | -4,96  | 2,41    | -5,41   | -5,94    | 1,08     | -2,69    |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI           | 0,61   | -0,94  | 1,32    | -1,33   | 1,09     | 7,99     | 16,22    |
| % do CDI                                          | 314,02 | -48,24 | 205,51  | -84,82  | 25,76    | 73,79    | 86,85    |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF                  | 1,86   | 0,53   | 2,86    | -0,08   | 6,90     | 26,22    |          |
| % do CDI                                          | 959,39 | 27,26  | 443,55  | -5,26   | 163,77   | 242,12   |          |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                | 0,24   | 1,61   | 0,75    | 1,26    | 3,74     | 10,19    | 18,03    |
| % do CDI                                          | 121,46 | 82,50  | 117,07  | 80,04   | 88,70    | 94,14    | 96,53    |
| BB PREV RF FLUXO FIC                              | 0,10   | 1,35   | 0,39    | 1,06    | 3,12     | 8,50     | 14,95    |
| % do CDI                                          | 52,46  | 68,95  | 60,44   | 67,36   | 74,14    | 78,50    | 80,06    |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO  | 0,02   | 0,40   | 0,07    | 0,28    | 1,35     | 4,66     | 8,85     |
| % do CDI                                          | 8,80   | 20,52  | 10,81   | 18,01   | 32,10    | 43,07    | 47,38    |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP     | 0,25   | 1,62   | 0,82    | 1,25    | 3,72     | 10,14    | 17,77    |
| % do CDI                                          | 127,85 | 83,02  | 127,63  | 79,33   | 88,18    | 93,65    | 95,15    |
| 33-BRB TESOIRO                                    | 0,09   | 1,27   | 0,37    | 0,99    | 3,06     | 8,71     | 15,03    |
| % do CDI                                          | 48,56  | 65,06  | 57,39   | 63,02   | 72,59    | 80,40    | 80,50    |
| FI BANESTES INVEST MONEY RF                       | 0,10   | 1,35   | 0,39    | 1,06    | 3,13     | 8,49     | 14,92    |
| % do CDI                                          | 51,49  | 68,90  | 59,93   | 67,45   | 74,17    | 78,45    | 79,90    |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF               | 0,12   | 1,46   | 0,43    | 1,15    | 3,35     | 8,99     | 15,76    |
| % do CDI                                          | 59,89  | 74,66  | 67,29   | 73,37   | 79,38    | 83,04    | 84,38    |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 4,40   | 2,46   | 8,09    | 2,22    | 7,80     | 36,97    | 45,75    |
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | 0,01   | -0,19  | -0,05   | -0,16   | -0,36    | -0,90    | -1,00    |
| NTN-B 150820                                      | 0,09   | 0,94   | 1,83    | 0,95    | 4,43     | 14,62    | 24,90    |
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | -4,30  | -1,71  | -6,31   | -1,43   | -3,72    | -23,24   | -21,85   |
| LFT 010921                                        | 0,20   | 1,94   | 0,65    | 1,56    | 4,22     | 10,85    | 18,75    |
| NTN-B 150822                                      | 0,81   | 4,32   | 4,18    | 3,64    | 8,98     | 26,93    | 37,37    |
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | -3,58  | 1,67   | -3,96   | 1,26    | 0,82     | -10,93   | -9,38    |
| LFT 010324                                        | 0,20   | 1,91   | 0,66    | 1,54    | 4,19     | 10,85    |          |
| NTN-B 150523                                      | 1,14   | 5,32   | 4,89    | 4,60    | 10,44    | 30,85    | 41,08    |
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | -3,25  | 2,67   | -3,25   | 2,22    | 2,28     | -7,01    | -5,68    |
| NTN-B 150521                                      | 0,32   | 2,27   | 2,27    | 1,98    | 6,22     | 19,31    | 30,47    |
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | -4,07  | -0,38  | -5,87   | -0,41   | -1,94    | -18,56   | -16,28   |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                                              | No Mês         | No Ano           | 3 meses          | 6 meses          | 12 meses         | 24 meses       | 36 meses        |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|-----------------|
| NTN-B 150830<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                                                        | 4,24<br>-0,15  | 5,17<br>2,52     | 9,17<br>1,03     | 3,95<br>1,57     | 10,50<br>2,35    | 43,92<br>6,06  | 51,96<br>5,20   |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 8,36<br>1,83   | -0,70<br>12,35   | 27,26<br>5,40    | -2,67<br>8,98    | 12,67<br>9,17    | 62,04<br>15,55 | 86,72<br>23,54  |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO<br>Var. IBOVESPA p.p.                                             | 9,27<br>1,01   | -14,17<br>-3,16  | 29,24<br>1,41    | -14,60<br>-5,06  | 6,10<br>5,02     | 47,15<br>17,25 | 63,31<br>7,19   |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.         | 8,32<br>1,79   | -9,87<br>3,18    | 21,78<br>-0,08   | -11,23<br>0,43   | 4,70<br>1,20     | 50,50<br>4,00  | 62,91<br>-0,28  |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS<br>Var. IBOVESPA p.p.                                                    | 6,77<br>-1,50  | -17,03<br>-6,02  | 19,26<br>-8,57   | -16,68<br>-7,15  | -7,01<br>-8,09   | 24,01<br>-5,90 | 35,50<br>-20,61 |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII<br>Var. IPCA p.p.                                               | 10,90<br>10,54 | 16,11<br>15,65   | 38,23<br>37,99   | -1,14<br>-1,39   | 60,62<br>58,32   | 76,55<br>70,95 | 57,66<br>47,32  |
| FIA BRASIL IBX-50<br>Var. IBOVESPA p.p.                                                      | 8,20<br>-0,07  | -11,75<br>-0,74  | 29,16<br>1,33    | -10,31<br>-0,77  | 0,13<br>-0,95    | 24,18<br>-5,73 | 50,71<br>-5,41  |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                              | 8,14<br>-0,12  | -11,05<br>-0,04  | 27,43<br>-0,41   | -9,54<br>-0,01   | 0,90<br>-0,18    | 29,08<br>-0,83 | 54,06<br>-2,06  |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                          | 8,08<br>-0,18  | -11,06<br>-0,05  | 27,18<br>-0,65   | -9,51<br>0,02    | 0,68<br>-0,40    | 28,59<br>-1,32 | 53,18<br>-2,94  |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI<br>Var. IBOVESPA p.p.                                                 | 8,44<br>0,18   | -10,49<br>0,52   | 27,78<br>-0,05   | -9,51<br>0,03    | 3,49<br>2,41     | 35,87<br>5,97  | 54,71<br>-1,40  |
| FIP CAIXA CYRELA<br>Var. IPCA p.p.                                                           | -3,16<br>-3,52 | -10,03<br>-10,49 | -18,31<br>-18,54 | -14,20<br>-14,45 | -20,44<br>-22,74 | 2,35<br>-3,25  | 1,00<br>-9,33   |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I<br>Var. IBOVESPA p.p.                                    | 1,88<br>-6,39  | 35,34<br>46,35   | 9,28<br>-18,55   | 27,06<br>36,60   | 55,47<br>54,39   | 69,34<br>39,44 | 132,22<br>76,11 |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I<br>Var. IBOVESPA p.p.                                 | 0,98<br>-7,29  | 30,58<br>41,59   | 5,63<br>-22,20   | 26,86<br>36,40   | 48,10<br>47,02   | 56,54<br>26,64 | 114,56<br>58,45 |
| CDI                                                                                          | 0,19           | 1,95             | 0,64             | 1,57             | 4,21             | 10,83          | 18,68           |
| IBOVESPA                                                                                     | 8,27           | -11,01           | 27,83            | -9,54            | 1,08             | 29,91          | 56,12           |
| INPC + 6%                                                                                    | 0,98           | 4,26             | 1,99             | 3,54             | 8,88             | 19,01          | 30,64           |
| IPCA + 6%                                                                                    | 0,90           | 3,91             | 1,73             | 3,16             | 8,47             | 18,63          | 31,32           |

## 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                       | 0,24   | 2,84   | 0,94    | 2,39    | 5,51     | 13,20    | 21,56    |
| IRF-M 1+                      | 1,47   | 7,59   | 4,50    | 6,40    | 12,02    | 32,81    | 43,78    |
| IRF-M TOTAL                   | 1,08   | 6,00   | 3,32    | 5,08    | 9,81     | 26,59    | 36,79    |
| IMA-B 5                       | 0,99   | 4,19   | 4,28    | 3,61    | 8,83     | 24,16    | 34,43    |
| IMA-B 5+                      | 7,32   | 1,68   | 11,51   | 1,64    | 7,81     | 49,37    | 56,19    |
| IMA-B TOTAL                   | 4,39   | 2,65   | 8,14    | 2,38    | 8,16     | 37,86    | 46,75    |
| IMA-C TOTAL                   | 4,26   | 12,04  | 11,01   | 9,27    | 15,97    | 43,97    | 64,91    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | 1,66   | 3,39   | 3,57    | 2,88    | 7,07     | 23,27    | 32,25    |
| IMA-GERAL TOTAL               | 1,74   | 3,64   | 3,79    | 3,07    | 7,33     | 23,84    | 33,11    |
| IDKA 2                        | 0,94   | 4,31   | 3,72    | 3,76    | 8,68     | 22,37    | 33,35    |
| IDKA 20                       | 12,08  | -1,74  | 17,28   | -0,38   | 4,95     | 69,37    | 71,28    |
| CDI                           | 0,19   | 1,95   | 0,64    | 1,57    | 4,21     | 10,83    | 18,68    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | 8,27   | -11,01 | 27,83   | -9,54   | 1,08     | 29,91    | 56,12    |
| IBRX 100                      | 8,41   | -10,43 | 28,20   | -9,30   | 2,17     | 33,69    | 59,04    |
| IBRX 50                       | 8,15   | -11,06 | 29,00   | -9,35   | 0,23     | 26,69    | 52,24    |
| SMALL CAP                     | 9,50   | -13,20 | 31,66   | -13,59  | 7,86     | 55,28    | 71,97    |
| IFIX                          | -2,61  | -14,53 | 4,97    | -11,18  | 2,77     | 26,86    | 32,28    |
| Índice Consumo - ICON         | 7,62   | -4,11  | 27,54   | -7,49   | 12,15    | 54,44    | 58,02    |
| Índice Dividendos - IDIV      | 6,53   | -13,05 | 21,87   | -11,65  | 3,50     | 46,49    | 63,19    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,36   | 0,46   | 0,24    | 0,25    | 2,31     | 5,60     | 10,34    |
| INPC                          | 0,44   | 0,80   | 0,49    | 0,61    | 2,69     | 5,94     | 9,76     |
| IGPM                          | 2,23   | 6,71   | 4,11    | 6,21    | 9,27     | 16,26    | 25,84    |
| SELIC                         | 0,19   | 1,95   | 0,64    | 1,57    | 4,21     | 10,83    | 18,69    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR | Data       | Ativo                                            | Aplicação     | Resgate      | Quantidade         | Valor Cota    |
|-----|------------|--------------------------------------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| 573 | 01/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 7.264,58     | 365,26605810       | 19,8884616800 |
| 579 | 01/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.881,35      | 0,00         | 893,31362900       | 2,1060352580  |
| 583 | 01/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 644,88        | 0,00         | 306,20569900       | 2,1060352580  |
| 586 | 01/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 464.764,99    | 0,00         | 57.285,56977367    | 8,1131250300  |
| 574 | 02/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 12.244,33    | 615,62233687       | 19,8893530400 |
| 580 | 02/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 12.232,87     | 0,00         | 5.808,19691400     | 2,1061389930  |
| 584 | 02/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 3.226,38      | 0,00         | 1.531,89319900     | 2,1061389930  |
| 575 | 03/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 234.174,63   | 11.773,34092735    | 19,8902445300 |
| 577 | 03/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00          | 5.800.000,00 | 714.879,89803483   | 8,1132509300  |
| 581 | 03/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 793,12        | 0,00         | 376,55884300       | 2,1062312420  |
| 585 | 03/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 769,80        | 0,00         | 365,48693400       | 2,1062312420  |
| 587 | 03/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 14.500.000,00 | 0,00         | 1.787.199,74608708 | 8,1132509300  |
| 576 | 06/07/2020 | BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI     | 0,00          | 3.686.767,78 | 186.876,71513149   | 19,7283421700 |
| 578 | 06/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 2.800.000,00  | 0,00         | 345.111,75266484   | 8,1133139600  |
| 582 | 06/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 664,22        | 0,00         | 315,34675300       | 2,1063162800  |
| 588 | 06/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 1.100.000,00  | 0,00         | 135.579,61711833   | 8,1133139600  |
| 590 | 06/07/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 1.745.677,74  | 0,00         | 932.712,48238152   | 1,8716140000  |
| 591 | 07/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 336,00       | 16,89118894        | 19,8920278000 |
| 592 | 07/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 3.732,02      | 0,00         | 1.771,74583600     | 2,1064082240  |
| 593 | 07/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 9.197,26      | 0,00         | 4.366,32362800     | 2,1064082240  |
| 594 | 07/07/2020 | 33-BRB TESOIRO                                   | 0,00          | 3.221,30     | 813,03693830       | 3,9620586080  |
| 595 | 07/07/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 0,00          | 1.745.677,74 | 932.665,64015327   | 1,8717080000  |
| 596 | 07/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 1.745.677,74  | 0,00         | 471.398,62734487   | 3,7031880000  |
| 597 | 08/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 19.000,00    | 955,11481221       | 19,8928963900 |
| 598 | 08/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 6.562,78      | 0,00         | 3.115,49234400     | 2,1064985160  |
| 599 | 08/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 12.009,52     | 0,00         | 5.701,17657700     | 2,1064985160  |
| 600 | 08/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 1.000.000,00  | 0,00         | 123.252,35205879   | 8,1134354300  |
| 601 | 08/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 114.517,06    | 0,00         | 14.114,49699586    | 8,1134354300  |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data       | Ativo                                            | Aplicação     | Resgate      | Quantidade       | Valor Cota    |
|-----|------------|--------------------------------------------------|---------------|--------------|------------------|---------------|
| 602 | 09/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 7.961,62     | 400,20679530     | 19,8937651600 |
| 603 | 09/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.570,98      | 0,00         | 745,74591200     | 2,1065888170  |
| 604 | 09/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.368,32      | 0,00         | 649,54299000     | 2,1065888170  |
| 605 | 09/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00          | 2.917,19     | 359,54778811     | 8,1134972800  |
| 606 | 10/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 181.648,94   | 9.130,54908213   | 19,8946348500 |
| 607 | 10/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 2.857,30      | 0,00         | 1.356,30350500   | 2,1066818660  |
| 608 | 10/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.996,00      | 0,00         | 947,46151800     | 2,1066818660  |
| 609 | 10/07/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 442.800,00    | 0,00         | 236.539,47239091 | 1,8719920000  |
| 610 | 13/07/2020 | BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI     | 0,00          | 1.733.503,63 | 87.767,56440299  | 19,7510736700 |
| 612 | 13/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 7.522,31      | 0,00         | 3.570,52598855   | 2,1067792320  |
| 613 | 13/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 4.828,38      | 0,00         | 2.291,83007249   | 2,1067792320  |
| 614 | 13/07/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 0,00          | 442.800,00   | 236.527,59542030 | 1,8720860000  |
| 615 | 13/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 442.800,00    | 0,00         | 119.533,23728562 | 3,7044090000  |
| 646 | 13/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00          | 17.303,36    | 2.132,63308600   | 8,1136132200  |
| 616 | 14/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.563,14      | 0,00         | 741,92361204     | 2,1068745820  |
| 617 | 14/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 9.034,76      | 0,00         | 4.288,22867635   | 2,1068745820  |
| 618 | 15/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 6.634,76      | 0,00         | 3.148,96691672   | 2,1069640220  |
| 619 | 15/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 12.594,44     | 0,00         | 5.977,52969130   | 2,1069640220  |
| 620 | 15/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 592.594,64    | 0,00         | 73.036,01117348  | 8,1137322600  |
| 611 | 16/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00          | 130.657,44   | 6.566,36419220   | 19,8979886200 |
| 621 | 16/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 9.421,38      | 0,00         | 4.471,33979131   | 2,1070597270  |
| 622 | 16/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 8.367,12      | 0,00         | 3.970,99327218   | 2,1070597270  |
| 623 | 16/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00          | 3.569,88     | 439,97678343     | 8,1137917600  |
| 624 | 17/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00          | 182.211,79   | 86.473,09044560  | 2,1071502020  |
| 625 | 17/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 64.880,46     | 0,00         | 30.790,61945296  | 2,1071502020  |
| 626 | 17/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 2.340,20      | 0,00         | 1.110,59951862   | 2,1071502020  |
| 627 | 17/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 1.710.872,15  | 0,00         | 210.858,20964384 | 8,1138512600  |
| 628 | 20/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 11.360.888,80 | 0,00         | 570.907,82964686 | 19,8996899500 |
| 637 | 20/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00          | 3.971.255,28 | 489.437,87506544 | 8,1139108400  |
| 638 | 20/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00          | 3.349.268,92 | 412.781,08498417 | 8,1139108400  |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data       | Ativo                                            | Aplicação      | Resgate        | Quantidade          | Valor Cota    |
|-----|------------|--------------------------------------------------|----------------|----------------|---------------------|---------------|
| 629 | 21/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00           | 21.455,43      | 1.078,13283688      | 19,9005440400 |
| 632 | 21/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00           | 54.282,23      | 25.758,73948065     | 2,1073325440  |
| 634 | 21/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 3.189,44       | 0,00           | 1.513,49629610      | 2,1073325440  |
| 640 | 21/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 19.200.000,00  | 0,00           | 2.366.289,12634576  | 8,1139704300  |
| 630 | 22/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00           | 667,38         | 33,53432734         | 19,9013981500 |
| 641 | 22/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 353.712,12     | 0,00           | 43.592,65617702     | 8,1140300000  |
| 631 | 23/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00           | 3.108.679,99   | 156.197,39137255    | 19,9022529100 |
| 633 | 23/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00           | 27.976,17      | 13.274,45603771     | 2,1075191270  |
| 635 | 23/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00           | 3.544,74       | 1.681,94914798      | 2,1075191270  |
| 636 | 23/07/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | 0,00           | 770.361,17     | 337.498,09065639    | 2,2825645280  |
| 642 | 23/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00           | 15.217.485,21  | 1.875.439,56454739  | 8,1140898900  |
| 643 | 23/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 4.200.000,00   | 0,00           | 517.618,12562321    | 8,1140898900  |
| 644 | 24/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 300.000,00     | 0,00           | 36.972,45069548     | 8,1141497100  |
| 645 | 24/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00           | 17.056,73      | 2.102,09702984      | 8,1141497100  |
| 647 | 27/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00           | 50.000.000,00  | 6.162.029,59458904  | 8,1142096500  |
| 648 | 27/07/2020 | BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                | 0,00           | 15.000.000,00  | 8.108.069,53999354  | 1,8500088000  |
| 649 | 28/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00           | 748.723,15     | 37.615,18478768     | 19,9048111600 |
| 650 | 28/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00           | 762,91         | 361,94628078        | 2,1077989760  |
| 651 | 28/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 142.800.000,00 | 0,00           | 17.598.626,99751610 | 8,1142693700  |
| 652 | 28/07/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | 17.500.000,00  | 0,00           | 7.663.861,86255982  | 2,2834440800  |
| 653 | 28/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI        | 15.000.000,00  | 0,00           | 5.548.416,13725585  | 2,7034742220  |
| 654 | 28/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 32.500.000,00  | 0,00           | 8.762.892,57421698  | 3,7088210000  |
| 655 | 29/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00           | 477.086,61     | 23.967,38318447     | 19,9056612200 |
| 656 | 29/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00           | 2.566.069,04   | 316.239,18933498    | 8,1143296800  |
| 657 | 30/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00           | 800.142,49     | 40.195,00879331     | 19,9065136200 |
| 658 | 30/07/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | 0,00           | 2.225.071,30   | 974.222,05107677    | 2,2839467630  |
| 659 | 30/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00           | 81.895,22      | 38.850,28695204     | 2,1079695010  |
| 660 | 30/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.228,62       | 0,00           | 582,84524488        | 2,1079695010  |
| 661 | 30/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 404,52         | 0,00           | 191,90030966        | 2,1079695010  |
| 662 | 30/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00           | 131.882.826,60 | 16.252.955,88445842 | 8,1143902400  |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data       | Ativo                                            | Aplicação | Resgate      | Quantidade       | Valor Cota    |
|-----|------------|--------------------------------------------------|-----------|--------------|------------------|---------------|
| 663 | 30/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00      | 5.453.077,31 | 672.025,51870367 | 8,1143902400  |
| 664 | 31/07/2020 | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 0,00      | 6.740,32     | 338,58423618     | 19,9073650800 |
| 665 | 31/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.915,56  | 0,00         | 908,67801249     | 2,1080734580  |
| 666 | 31/07/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 1.306,28  | 0,00         | 619,65582605     | 2,1080734580  |
| 667 | 31/07/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00      | 1.207,48     | 148,80613754     | 8,1144502500  |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

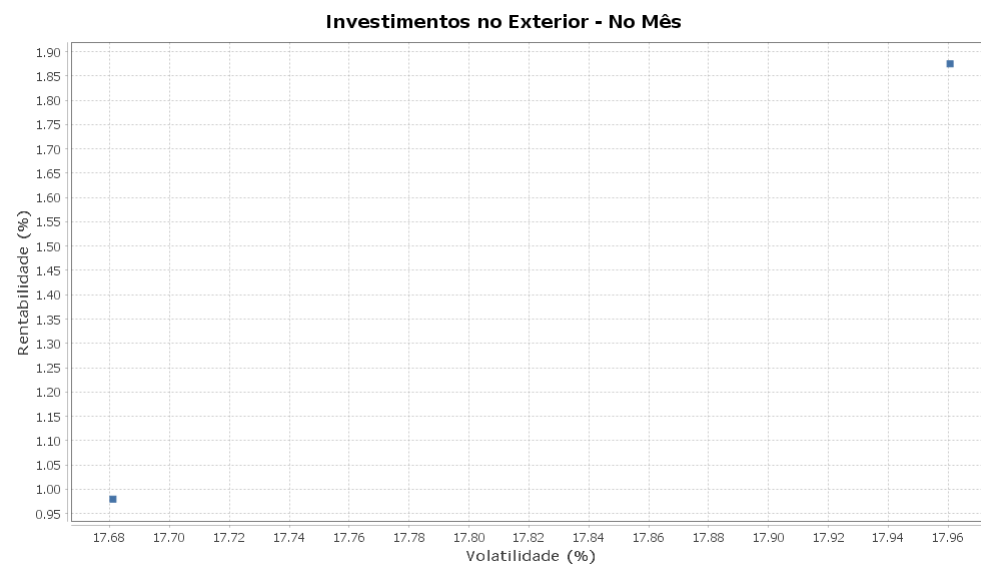
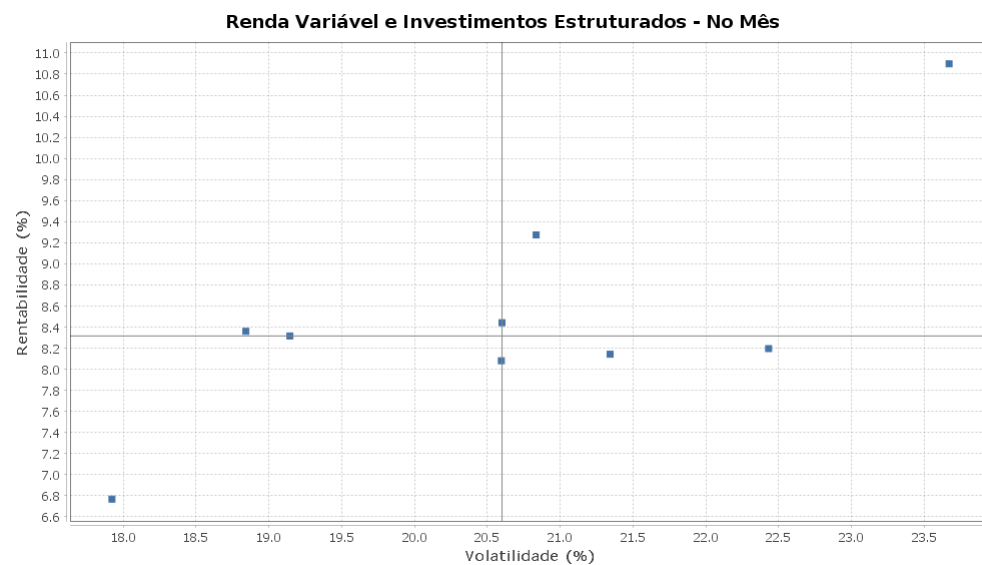
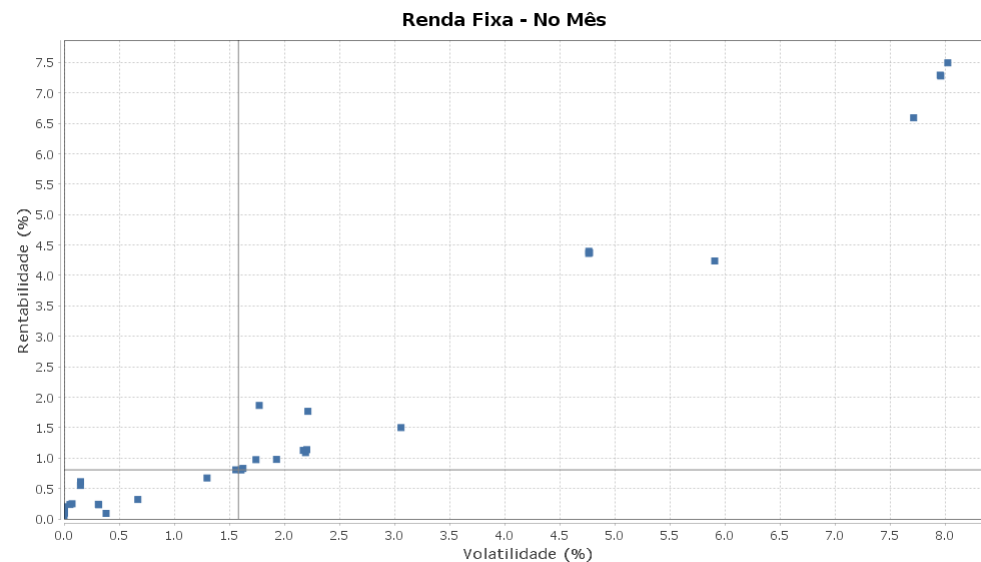
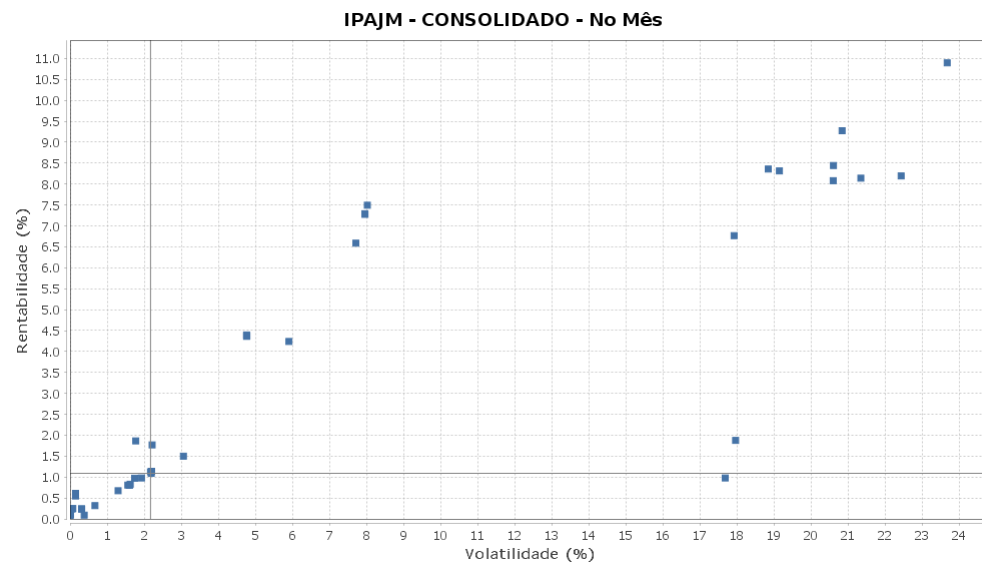
Rendimentos Realizados

| Artigo                 | Ativo                                            | Quantidade        | Valor Aplicação | Valor Resgate  | Rendimento   |
|------------------------|--------------------------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|--------------|
| Artigo 7º IV, Alínea a | 33-BRB TESOIRO                                   | 813,036938        | 3.195,52        | 3.221,30       | 25,78        |
| Artigo 7º IV, Alínea a | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 26.900.971,670543 | 218.264.400,89  | 218.282.037,01 | 17.636,12    |
| Artigo 7º I, Alínea b  | BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                | 8.108.069,539994  | 12.794.687,58   | 15.000.000,00  | 2.205.312,42 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI     | 274.644,279534    | 5.537.204,78    | 5.420.271,41   | -116.933,37  |
| Artigo 7º IV, Alínea a | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 166.400,468345    | 349.701,00      | 350.673,07     | 972,07       |
| Artigo 7º IV, Alínea a | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | 1.311.720,141733  | 2.850.990,43    | 2.995.432,47   | 144.442,04   |
| Artigo 7º IV, Alínea a | FI BANESTES INVEST MONEY RF                      | 289.248,574932    | 5.753.804,80    | 5.756.782,91   | 2.978,11     |
| Artigo 7º IV, Alínea a | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 1.169.193,235574  | 2.188.367,67    | 2.188.477,74   | 110,07       |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                               | Estratégia              | Volatilidade | VaR  | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|-----------------------------------------------------|-------------------------|--------------|------|-------|----------------|------------|
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO    | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,00         | 0,00 | 0,02  | 52.210.413,20  | 1,08       |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF                 | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,00         | 0,01 | 0,12  | 161,91         | 0,00       |
| 33-BRB TESOIRO                                      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,00         | 0,00 | 0,09  | 5.738,98       | 0,00       |
| LFT 010324                                          | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,00         | 0,01 | 0,20  | 111.964.537,48 | 2,31       |
| LFT 010921                                          | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,00         | 0,01 | 0,20  | 246.718.453,70 | 5,10       |
| FI BANESTES INVEST MONEY RF                         | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,00         | 0,00 | 0,10  | 6.558.893,01   | 0,14       |
| 35-BRB MILLENIUM                                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,00         | 0,01 | 0,15  | 1.388.390,66   | 0,03       |
| BB PREV RF FLUXO FIC                                | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,00         | 0,00 | 0,10  | 416.495,75     | 0,01       |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                  | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,05         | 0,02 | 0,24  | 327.393.523,00 | 6,76       |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP       | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,07         | 0,02 | 0,25  | 129.939.525,99 | 2,68       |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI        | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,15         | 0,04 | 0,55  | 8.668.825,91   | 0,18       |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI             | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,15         | 0,04 | 0,61  | 169.770.705,11 | 3,51       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,31         | 0,04 | 0,24  | 40.306.177,05  | 0,83       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,31         | 0,04 | 0,23  | 303.546.953,68 | 6,27       |
| NTN-B 150820                                        | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,38         | 0,04 | 0,09  | 34.038.312,54  | 0,70       |
| NTN-B 150521                                        | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,67         | 0,08 | 0,32  | 316.412.683,83 | 6,54       |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,30         | 0,16 | 0,67  | 1.414.423,24   | 0,03       |
| BB PREV RF IDKA2                                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,56         | 0,20 | 0,81  | 29.449.682,27  | 0,61       |
| NTN-B 150822                                        | Artigo 7º I, Alínea a   | 1,61         | 0,20 | 0,81  | 414.870.281,65 | 8,57       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,62         | 0,20 | 0,83  | 32.943.267,65  | 0,68       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,74         | 0,22 | 0,97  | 34.592.084,86  | 0,71       |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF                    | Artigo 7º IV, Alínea a  | 1,77         | 0,26 | 1,86  | 7.264.591,70   | 0,15       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,93         | 0,24 | 0,98  | 701.033.789,50 | 14,48      |
| BB PREV RF IRF-M                                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,17         | 0,27 | 1,13  | 50.453.656,18  | 1,04       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,19         | 0,27 | 1,09  | 37.149.945,22  | 0,77       |
| NTN-B 150523                                        | Artigo 7º I, Alínea a   | 2,20         | 0,28 | 1,14  | 76.701.989,40  | 1,58       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,21         | 0,31 | 1,77  | 668.181.616,89 | 13,80      |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO                     | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,06         | 0,38 | 1,50  | 21.260.740,14  | 0,44       |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,76         | 0,68 | 4,36  | 14.047.456,88  | 0,29       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP   | Artigo 7º III, Alínea a | 4,76         | 0,68 | 4,40  | 2.094.982,57   | 0,04       |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                                  | Estratégia             | Volatilidade | VaR  | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--------------------------------------------------------|------------------------|--------------|------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP           | Artigo 7º I, Alínea b  | 4,77         | 0,68 | 4,38  | 14.200.588,04  | 0,29       |
| NTN-B 150830                                           | Artigo 7º I, Alínea a  | 5,91         | 0,79 | 4,24  | 120.817.280,50 | 2,50       |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                           | Artigo 7º IV, Alínea a | 7,71         | 1,08 | 6,59  | 33.410.699,15  | 0,69       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | Artigo 7º I, Alínea b  | 7,95         | 1,13 | 7,29  | 11.220.418,59  | 0,23       |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI                 | Artigo 7º I, Alínea b  | 7,96         | 1,13 | 7,28  | 7.854.983,90   | 0,16       |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B                    | Artigo 7º I, Alínea b  | 8,02         | 1,15 | 7,49  | 35.904.427,40  | 0,74       |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I                 | Artigo 9º A, III       | 17,68        | 1,87 | 0,98  | 21.483.110,71  | 0,44       |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                                    | Artigo 8º II, Alínea a | 17,92        | 2,14 | 6,77  | 127.513.534,40 | 2,63       |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                    | Artigo 9º A, III       | 17,96        | 1,94 | 1,88  | 87.319.733,33  | 1,80       |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | Artigo 8º II, Alínea a | 18,84        | 2,30 | 8,36  | 5.490.161,59   | 0,11       |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS         | Artigo 8º II, Alínea a | 19,14        | 2,33 | 8,32  | 30.794.220,98  | 0,64       |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA                          | Artigo 8º I, Alínea a  | 20,60        | 2,47 | 8,08  | 9.466.946,58   | 0,20       |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                                 | Artigo 8º I, Alínea a  | 20,60        | 2,49 | 8,44  | 102.280.605,46 | 2,11       |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                             | Artigo 8º II, Alínea a | 20,83        | 2,54 | 9,27  | 151.890.163,53 | 3,14       |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA                              | Artigo 8º I, Alínea a  | 21,34        | 2,55 | 8,14  | 54.856.052,35  | 1,13       |
| FIA BRASIL IBX-50                                      | Artigo 8º I, Alínea a  | 22,43        | 2,67 | 8,20  | 150.013.619,72 | 3,10       |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII                           | Artigo 8º IV, Alínea b | 23,67        | 2,90 | 10,90 | 34.600.000,00  | 0,71       |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

-Referente ao mês de julho de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 15,32% do patrimônio líquido do fundo FIA BRASIL IBX-50 (Art. 8, Inciso I, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 22,49% do patrimônio líquido do fundo CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII (Art. 8, Inciso IV, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;