



LDB
EMPRESAS

IPREMAR
MAIO 2023



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 31.05.2023.

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

92,86%

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

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Ano | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (5,545866%) | 1,54 | 0,04 | 1,05 | 5,64 | 4.085.050,81 | 2,85 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (5,593447%) | 0,47 | 0,05 | 1,05 | 5,66 | 2.149.141,76 | 1,50 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (5,775010%) | 4,12 | 0,04 | 1,07 | 1,54 | 8.509.229,66 | 5,93 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (6,044849%) | 3,01 | 0,04 | 1,09 | 5,84 | 2.095.781,16 | 1,46 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,49 | 0,04 | 1,07 | 5,70 | 16.839.203,39 | 11,73 |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------|----------|---|---------------------|-------------------|------|-------|---------------|------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF IRF M | 3,54 | 0,03 | 2,17 | 7,20 | 5.025.473,65 | 3,50 | 4.005.393.556,18 | 0,13 |
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,39 | 0,04 | 1,12 | 5,27 | 3.861.528,14 | 2,69 | 6.724.495.811,47 | 0,06 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 5,26 | -0,01 | 2,58 | 8,70 | 6.019.980,34 | 4,19 | 5.943.377.738,68 | 0,10 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 5,30 | -0,02 | 2,50 | 8,63 | 921.040,39 | 0,64 | 435.684.441,46 | 0,21 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,34 | -0,01 | 2,53 | 8,69 | 9.795.023,40 | 6,82 | 3.621.007.048,62 | 0,27 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,38 | 0,04 | 1,12 | 5,37 | 3.855.368,30 | 2,69 | 7.491.213.170,65 | 0,05 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,45 | 0,00 | 0,63 | 5,91 | 15.068.365,71 | 10,50 | 8.623.099.025,61 | 0,17 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 2,69 | 0,01 | 0,39 | 5,49 | 7.775.936,55 | 5,42 | 7.232.116.284,73 | 0,11 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | 8,27 | -0,02 | 4,12 | 10,99 | 16.862.830,92 | 11,75 | 856.178.470,48 | 1,97 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP | 5,31 | 0,03 | 2,84 | 8,39 | 3.960.054,33 | 2,76 | 1.321.509.484,64 | 0,30 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,79 | 0,01 | 0,36 | 5,50 | 5.256.875,95 | 3,66 | 6.636.813.957,94 | 0,08 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,01 | 0,05 | 0,97 | 4,60 | 2.533.357,03 | 1,76 | 900.415.296,74 | 0,28 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|------------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2,47 | 0,00 | 0,61 | 5,90 | 4.577.174,75 | 3,19 | 5.869.025.714,56 | 0,08 |
| BANRISUL | BANRISUL | BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP | 2,48 | 0,03 | 1,85 | 6,85 | 1.262.457,76 | 0,88 | 444.198.285,87 | 0,28 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 3,93 | 0,00 | 1,89 | 7,47 | 86.775.467,22 | 60,45 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|---------|--|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 5,81 | -0,03 | 2,76 | 8,93 | 2.167.619,98 | 1,51 | 320.650.657,68 | 0,68 |
| BRAM | BRDESCO | BRDESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 2,55 | 0,02 | 1,75 | 6,58 | 769.434,95 | 0,54 | 180.011.491,43 | 0,43 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP | 5,46 | -0,01 | 2,57 | 8,71 | 7.489.709,59 | 5,22 | 1.265.571.591,84 | 0,59 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B | 5,30 | -0,01 | 2,64 | 8,72 | 12.615.686,77 | 8,79 | 669.374.985,98 | 1,88 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,02 | 0,05 | 1,04 | 4,93 | 6.612.535,21 | 4,61 | 3.860.323.166,27 | 0,17 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 4,14 | 0,00 | 2,25 | 7,52 | 29.654.986,50 | 20,66 | | |

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-------------|---------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|------------------|-------------|---------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| ICLA TRUST | MACROINVEST | SANTOS CREDIT YIELD | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.820,79 | 0,02 | 31.361.299,36 | 0,07 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea b | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.820,79 | 0,02 | | |

| | | | | | | | | | | |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|--|--|
| Renda Fixa | | | 3,73 | 0,01 | 1,87 | 7,30 | 133.291.477,90 | 92,86 | | |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

7,14%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|--|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA DIVIDENDOS | 18,46 | -0,84 | 0,68 | -0,08 | 2.085.047,60 | 1,45 | 219.320.739,31 | 0,95 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 18,66 | -0,83 | 2,30 | 1,88 | 4.948.592,04 | 3,45 | 889.314.500,47 | 0,56 |
| BB | BB | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 21,50 | -0,47 | 4,08 | -2,17 | 3.213.193,44 | 2,24 | 745.369.833,92 | 0,43 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 19,26 | -0,72 | 2,52 | 0,18 | 10.246.833,08 | 7,14 | | |
| Renda Variável | | | 19,26 | -0,72 | 2,52 | 0,18 | 10.246.833,08 | 7,14 | | |
| Total | | | 4,48 | -0,04 | 1,91 | 6,74 | 143.538.310,98 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | Pró-Gestão Nível 1 | |
|-------------------------|------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 16.839.203,39 | 11,73 | 0,00 | 35,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 86.775.467,22 | 60,45 | 0,00 | 29,51 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 29.654.986,50 | 20,66 | 0,00 | 14,98 | 60,00 | 0,00 | 65,00 |
| Artigo 7º V, Alínea b | FI RF - Crédito Privado | 21.820,79 | 0,02 | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 133.291.477,90 | 92,86 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 10.246.833,08 | 7,14 | 0,00 | 0,49 | 30,00 | 0,00 | 35,00 |
| | Total Renda Variável | 10.246.833,08 | 7,14 | | | | | 35,00 |
| Total | | 143.538.310,98 | 100,00 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|-------------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------------|---------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 1,07 94,87 | 5,70 106,16 | 3,50 107,63 | 6,62 101,03 | | 177.560,42 | 581.644,47 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,89 168,53 | 7,47 139,19 | 5,66 174,03 | 7,92 120,80 | 10,63 78,86 | 1.592.308,10 | 5.927.278,55 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 2,25 200,08 | 7,52 140,15 | 5,97 183,61 | 7,54 115,11 | 9,95 73,81 | 652.045,07 | 2.307.647,85 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | 2,52 -1,22 | 0,18 1,45 | 3,58 0,34 | -2,14 1,55 | -2,42 0,29 | 251.531,52 | 18.184,42 |
| IPREMAR (Total) | | | | | | 2.673.445,11 | 8.834.755,29 |

RESULTADO POR ATIVO

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150830 (5,545866%) | 4.042.589,19 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.085.050,81 | 42.461,62 | 219.921,94 |
| NTN-B 150830 (5,593447%) | 2.126.723,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.149.141,76 | 22.418,63 | 116.062,96 |
| NTN-B 150830 (5,775010%) | 8.419.187,59 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.509.229,66 | 90.042,07 | 128.948,49 |
| NTN-B 150830 (6,044849%) | 2.073.143,06 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.095.781,16 | 22.638,10 | 116.711,08 |
| | | | | | 16.839.203,39 | 177.560,42 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|--------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP | 1.239.536,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.262.457,76 | 22.921,05 | 80.935,88 |
| BB PREV RF IDKA2 | 7.745.820,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.775.936,55 | 30.116,22 | 402.611,39 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 5.868.798,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.019.980,34 | 151.181,82 | 481.889,85 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 4.549.380,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.577.174,75 | 27.793,79 | 254.919,59 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | 16.195.870,83 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.862.830,92 | 666.960,09 | 1.670.177,32 |
| BB PREV RF IRF M | 4.918.525,38 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.025.473,65 | 106.948,27 | 337.556,73 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 2.250.537,89 | 1.579.000,00 | 0,00 | 0,00 | 3.861.528,14 | 31.990,25 | 113.827,15 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 898.555,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 921.040,39 | 22.484,53 | 73.197,54 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 2.509.018,48 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.533.357,03 | 24.338,55 | 111.497,31 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5.237.996,85 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.256.875,95 | 18.879,10 | 273.919,28 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 14.973.947,38 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.068.365,71 | 94.418,33 | 841.002,39 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 9.552.911,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.795.023,40 | 242.111,75 | 782.806,44 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.812.536,57 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.855.368,30 | 42.831,73 | 196.342,92 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP | 3.850.721,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.960.054,33 | 109.332,62 | 306.594,76 |
| | | | | | 86.775.467,22 | 1.592.308,10 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC | 6.569.152,70 | 0,00 | -25.000,00 | 0,00 | 6.612.535,21 | 68.382,51 | 470.494,94 |
| BB PREV RF IMA-B | 12.291.418,76 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.615.686,77 | 324.268,01 | 1.011.870,38 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 756.223,31 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 769.434,95 | 13.211,64 | 47.523,29 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP | 7.301.832,87 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.489.709,59 | 187.876,72 | 600.067,40 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 2.109.313,79 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.167.619,98 | 58.306,19 | 177.691,84 |
| | | | | | 29.654.986,50 | 652.045,07 | |

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---------------------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|
| SANTOS CREDIT YIELD | 21.820,79 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.820,79 | 0,00 | 0,00 |
| | | | | | 21.820,79 | 0,00 | |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 3.087.324,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.213.193,44 | 125.868,63 | -71.367,32 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | 2.070.879,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.085.047,60 | 14.168,51 | -1.640,40 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 4.837.097,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.948.592,04 | 111.494,38 | 91.192,14 |
| | | | | | 10.246.833,08 | 251.531,52 | |

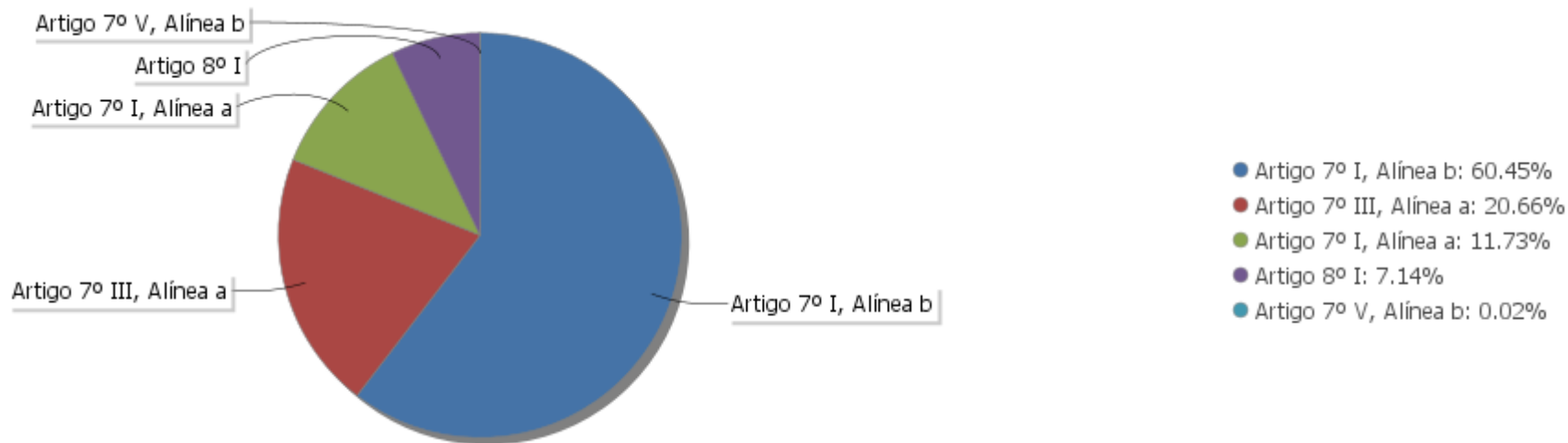
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

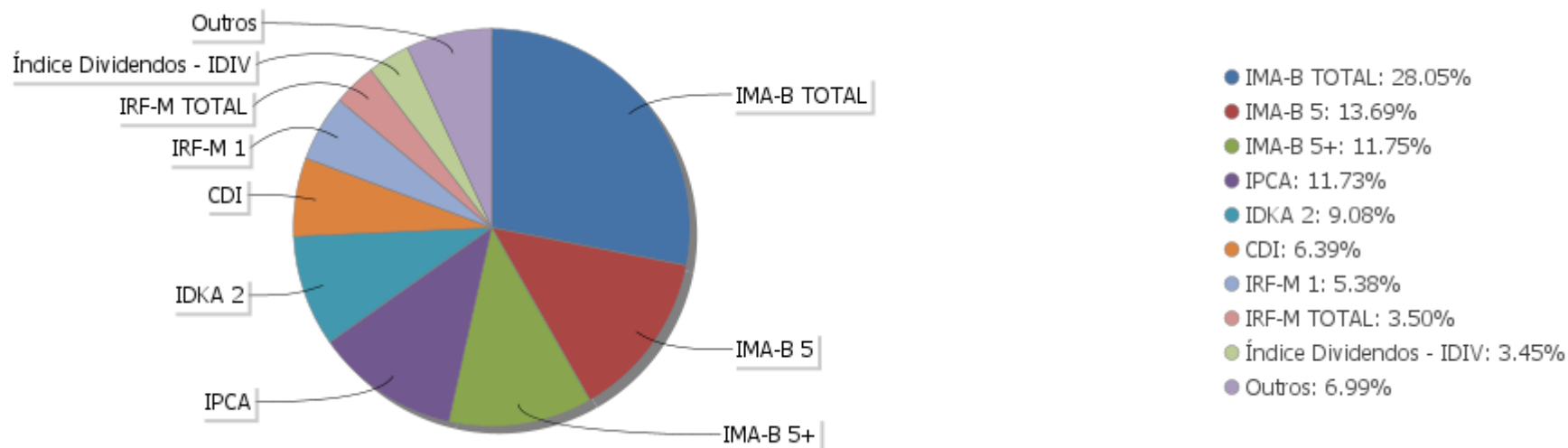
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo |
|-----------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|-------------------|
| de 0 a 30 dias | 121.750.515,55 | 84,82 | 121.750.515,55 | 84,82 | |
| de 31 dias a 365 dias | 4.948.592,04 | 3,45 | 126.699.107,59 | 88,27 | |
| acima de 365 dias | 16.839.203,39 | 11,73 | 143.538.310,98 | 100,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

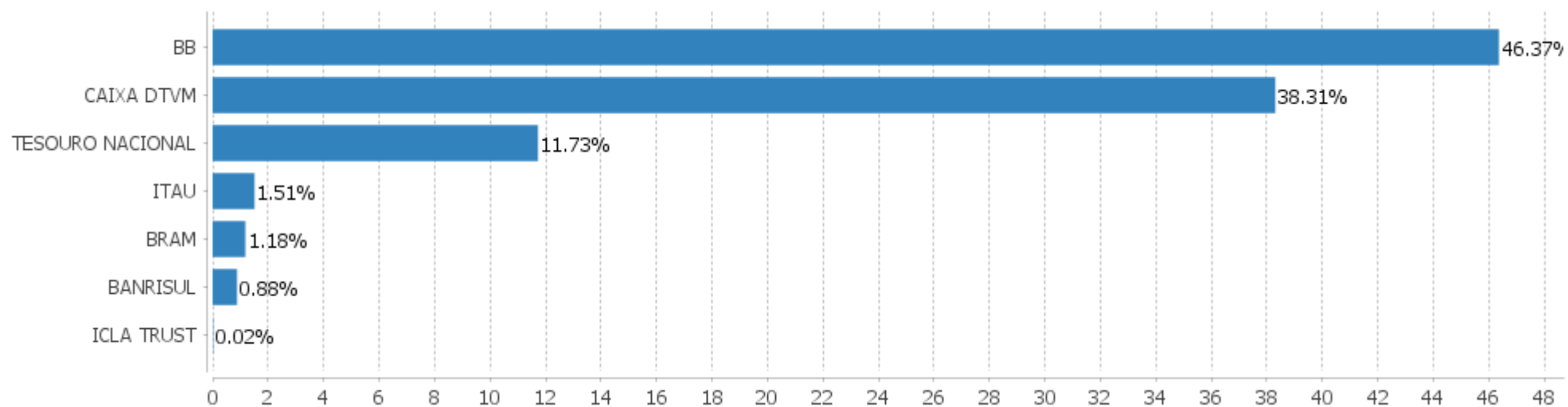


Alocação Por Estratégia



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 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2023 | 0,77 | 0,51 | 1,75 | 1,62 | 1,91 | | | | | | | | 6,74 |
| IPCA + 5,24% | 0,98 | 1,21 | 1,18 | 0,98 | 0,68 | | | | | | | | 5,12 |
| p.p. indexador | -0,20 | -0,70 | 0,57 | 0,64 | 1,24 | | | | | | | | 1,61 |
| 2022 | 0,28 | 0,52 | 2,99 | -0,02 | 1,10 | -0,96 | -0,10 | 1,34 | 1,05 | 1,56 | -0,67 | 0,11 | 7,37 |
| IPCA + 4,92% | 0,94 | 1,38 | 2,05 | 1,43 | 0,89 | 1,07 | -0,28 | 0,08 | 0,11 | 0,97 | 0,79 | 1,04 | 10,97 |
| p.p. indexador | -0,67 | -0,86 | 0,94 | -1,44 | 0,21 | -2,03 | 0,18 | 1,26 | 0,94 | 0,58 | -1,46 | -0,93 | -3,60 |
| 2021 | -1,09 | -1,64 | 0,26 | 0,88 | 1,45 | 0,15 | -0,69 | -0,97 | -0,65 | -2,60 | 2,69 | 0,57 | -1,75 |
| INPC + 5,43% | 0,69 | 1,20 | 1,35 | 0,80 | 1,41 | 1,04 | 1,49 | 1,35 | 1,65 | 1,59 | 1,26 | 1,22 | 16,12 |
| p.p. indexador | -1,78 | -2,84 | -1,09 | 0,08 | 0,04 | -0,90 | -2,17 | -2,32 | -2,30 | -4,19 | 1,42 | -0,64 | -17,87 |
| 2020 | 0,34 | -0,51 | -8,23 | 1,90 | 1,99 | 2,11 | 3,91 | -1,72 | -1,58 | 0,10 | 2,92 | 4,51 | 5,22 |
| INPC + 6,00% | 0,70 | 0,59 | 0,69 | 0,23 | 0,21 | 0,79 | 0,98 | 0,85 | 1,36 | 1,38 | 1,42 | 1,98 | 11,75 |
| p.p. indexador | -0,36 | -1,10 | -8,92 | 1,66 | 1,78 | 1,33 | 2,94 | -2,56 | -2,94 | -1,28 | 1,51 | 2,53 | -6,53 |
| 2019 | 3,51 | 0,40 | 0,47 | 1,27 | 2,74 | 3,16 | 1,19 | -0,11 | 2,37 | 2,86 | -1,69 | 2,40 | 20,09 |
| INPC + 6,00% | 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 | 2,64 | -0,61 | -0,74 | 0,18 | 2,08 | 2,71 | 0,56 | -0,74 | 1,93 | 2,29 | -2,69 | 0,68 | 9,31 |
| 2018 | 2,43 | 0,58 | 0,89 | 0,09 | -2,37 | -0,26 | 1,91 | -0,36 | 0,27 | 5,21 | 0,92 | 1,41 | 11,04 |
| INPC + 6,00% | 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 | 1,68 | -0,02 | 0,33 | -0,60 | -3,28 | -2,19 | 1,15 | -0,89 | -0,47 | 4,29 | 0,70 | 0,80 | 1,45 |

Performance Sobre a Meta Atuarial

| | Quantidade | Perc. (%) |
|---------------------------------|---------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 32 | 49,23 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 33 | 50,77 |
| | Rentabilidade | Mês |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,21 | 2018-10 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -8,23 | 2020-03 |

Relatório

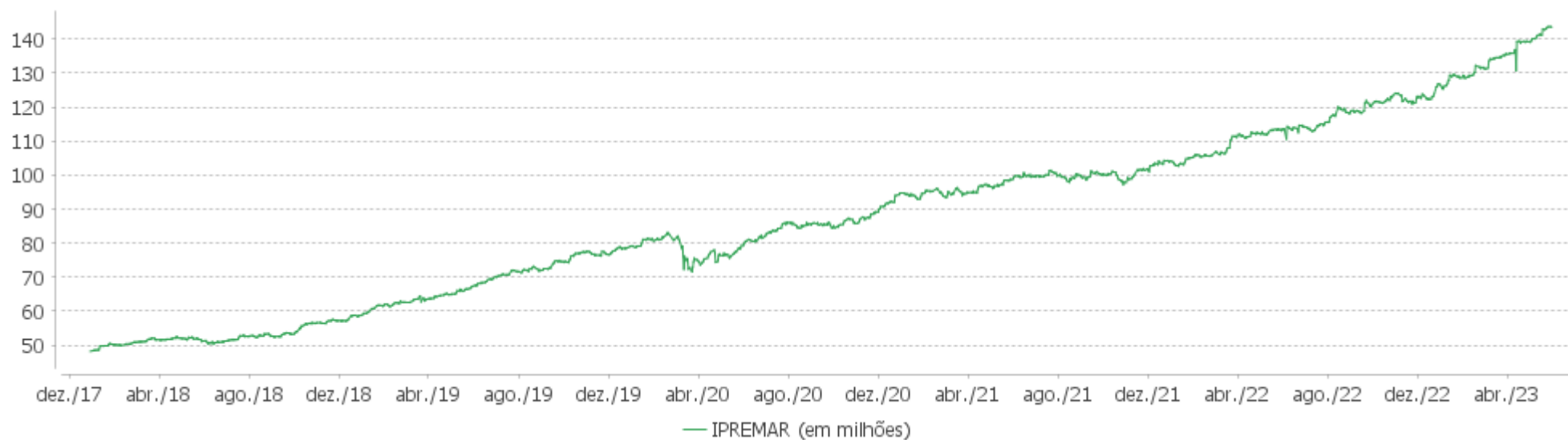
| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses | 5,38 | 2,86 | 2,52 | 2,52 |
| 06 meses | 6,86 | 6,22 | 0,64 | 3,73 |
| 12 meses | 9,22 | 9,16 | 0,05 | 4,48 |
| 24 meses | 12,80 | 28,31 | -15,51 | 4,76 |
| 36 meses | 24,44 | 47,76 | -23,32 | 5,09 |
| 48 meses | 30,97 | 59,80 | -28,83 | 7,69 |
| 60 meses | 55,55 | 77,44 | -21,89 | 7,17 |
| Desde 29/12/2017 | 57,99 | 83,76 | -25,77 | 6,95 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

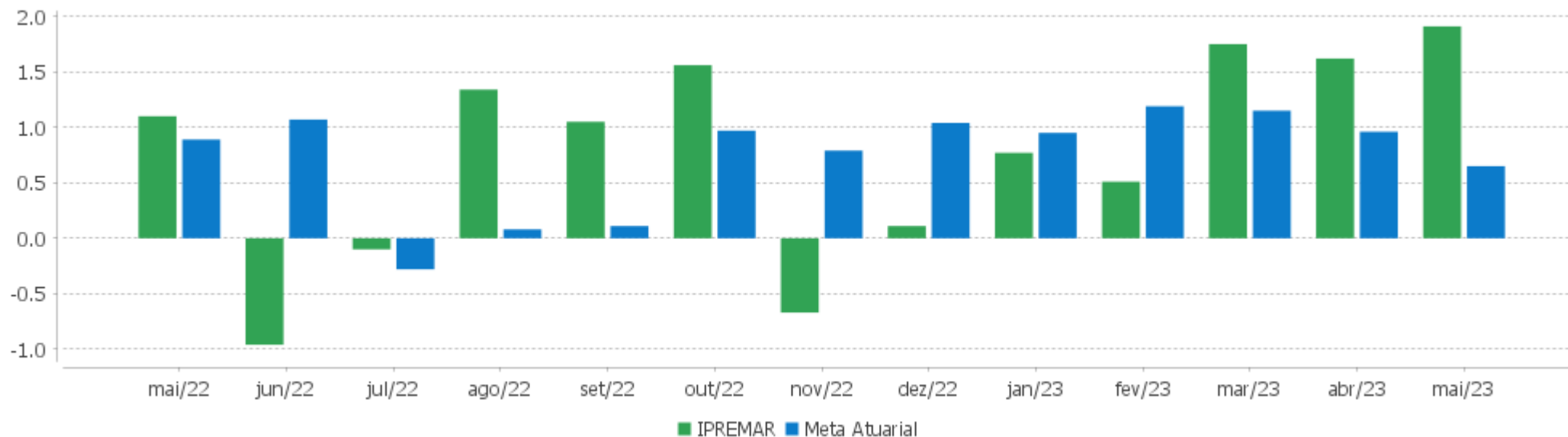


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| SANTOS CREDIT YIELD % do CDI | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 3,38 15,07 | 45,64 181,84 |
| NTN-B 150830 (6,044849%) Var. IPCA p.p. | 1,09 0,86 | 5,84 2,89 | 3,58 2,02 | 6,77 3,18 | 7,18 3,24 | | |
| NTN-B 150830 (5,593447%) Var. IPCA p.p. | 1,05 0,82 | 5,66 2,71 | 3,48 1,93 | 6,55 2,96 | 9,89 5,96 | 22,88 6,75 | 31,64 6,16 |
| NTN-B 150830 (5,775010%) Var. IPCA p.p. | 1,07 0,84 | 2,74 -0,21 | 3,51 1,96 | 3,62 0,03 | 3,93 -0,01 | | |
| NTN-B 150830 (5,545866%) Var. IPCA p.p. | -0,00 -0,23 | 5,64 2,69 | 3,46 1,90 | 6,52 2,93 | 9,83 5,90 | 22,77 6,64 | 31,49 6,01 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,53 0,00 | 8,69 -0,08 | 7,37 -0,02 | 8,43 -0,12 | 10,29 -0,18 | 15,07 -0,47 | 25,33 -0,80 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,63 0,06 | 5,91 -0,02 | 3,04 0,02 | 6,89 -0,04 | 9,41 -0,03 | 19,60 -0,30 | 28,08 -0,68 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 1,12 -0,02 | 5,27 -0,15 | 3,18 -0,08 | 6,49 -0,17 | 13,21 -0,32 | 20,16 -0,66 | 22,24 -1,13 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,61 0,04 | 5,90 -0,03 | 3,02 0,00 | 6,87 -0,06 | 9,27 -0,18 | 19,30 -0,59 | 27,79 -0,97 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,50 -0,03 | 8,63 -0,13 | 7,31 -0,08 | 8,39 -0,16 | 10,13 -0,34 | 14,77 -0,77 | 24,87 -1,26 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI | 0,97 86,36 | 4,60 85,75 | 2,80 86,01 | 5,61 85,64 | 11,56 85,76 | 18,74 83,53 | 20,31 80,91 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p. | 2,84 -0,01 | 8,39 -0,15 | 6,81 -0,11 | 10,09 -0,20 | 15,28 -0,56 | 13,87 -0,93 | 13,34 -1,14 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 0,39 0,10 | 5,49 -0,27 | 2,47 -0,13 | 6,77 -0,30 | 8,61 -0,13 | 18,88 0,09 | 28,11 -0,73 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,36 0,07 | 5,50 -0,26 | 2,49 -0,11 | 6,80 -0,27 | 8,34 -0,40 | 18,22 -0,57 | 27,61 -1,23 |
| BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p. | 2,17 -0,02 | 7,20 -0,14 | 5,47 -0,07 | 8,74 -0,19 | 14,38 -0,35 | 15,91 -0,66 | 16,50 -0,90 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 1,12 -0,02 | 5,37 -0,06 | 3,20 -0,06 | 6,58 -0,08 | 13,30 -0,22 | 20,31 -0,52 | 22,58 -0,79 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 2,58 | 8,70 | 7,35 | 8,46 | 10,27 | 14,95 | 25,18 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,04 | -0,06 | -0,04 | -0,09 | -0,20 | -0,60 | -0,96 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,85 -0,68 | 6,85 -1,91 | 5,08 -2,31 | 7,72 -0,83 | 12,76 2,29 | 18,35 2,81 | 22,12 -4,02 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p. | 4,12 -0,02 | 10,99 -0,17 | 11,13 -0,15 | 9,67 -0,16 | 10,95 -0,36 | 10,24 -0,79 | 21,58 -1,31 |
| BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,64 0,11 | 8,72 -0,04 | 7,43 0,04 | 8,46 -0,09 | 10,14 -0,33 | 15,01 -0,53 | 25,20 -0,94 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,76 0,23 | 8,93 0,17 | 7,70 0,31 | 8,66 0,11 | 9,01 -1,46 | 14,13 -1,41 | 23,94 -2,19 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,57 0,04 | 8,71 -0,05 | 7,49 0,10 | 8,42 -0,13 | 10,21 -0,26 | 14,97 -0,58 | 25,16 -0,98 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 1,04 92,96 | 4,93 91,88 | 2,98 91,76 | 6,02 91,84 | 12,36 91,75 | 19,92 88,82 | 21,20 84,44 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 1,75 -0,02 | 6,58 -0,20 | 4,85 -0,10 | 7,39 -0,21 | 12,03 -0,52 | 17,05 -1,42 | 22,27 -1,18 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 2,30 1,47 | 1,88 1,40 | 5,00 2,36 | -0,59 0,55 | -0,78 0,07 | -6,36 -7,90 | 28,12 -11,86 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p. | 0,68 -3,05 | -0,08 1,20 | 2,23 -1,01 | -1,65 2,04 | -1,88 0,83 | -2,84 11,33 | 21,92 -2,03 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p. | 4,08 -0,12 | -2,17 -0,77 | 2,33 -0,72 | -4,74 -0,81 | -5,16 -1,27 | -18,12 -1,92 | 19,61 -4,25 |
| IPREMAR Var. IPCA + 4,92% p.p. | 1,91 1,24 | 6,74 1,61 | 5,38 2,52 | 6,86 0,61 | 9,22 -0,14 | 12,80 -15,79 | 24,44 -21,77 |
| CDI | 1,12 | 5,37 | 3,25 | 6,55 | 13,48 | 22,43 | 25,10 |
| IBOVESPA | 3,74 | -1,28 | 3,24 | -3,69 | -2,71 | -14,17 | 23,95 |
| INPC + 6,00% | 0,87 | 5,27 | 3,03 | 6,53 | 9,94 | 30,40 | 50,49 |
| IPCA + 6,00% | 0,74 | 5,43 | 3,05 | 6,63 | 10,15 | 30,45 | 49,38 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP | | | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,00 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 1,00 |
| BB PREV RF IDKA2 | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IMA-B | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,30 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | D+0 | D+0 | D+2 du | D+2 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IRF M | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,10 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,25 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,80 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | D+1 du | D+0 | D+30 du | D+32 du | | 1,72 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,50 |
| SANTOS CREDIT YIELD | Não se aplica | Não se aplica | Não se aplica | Não se aplica | | 2,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 1,14 | 5,42 | 3,26 | 6,67 | 13,53 | 20,82 | 23,37 | 31,17 | 40,60 |
| IRF-M 1+ | 2,85 | 8,54 | 6,92 | 10,30 | 15,84 | 14,80 | 14,48 | 30,11 | 50,74 |
| IRF-M TOTAL | 2,20 | 7,34 | 5,54 | 8,93 | 14,73 | 16,57 | 17,40 | 30,67 | 48,09 |
| IMA-B 5 | 0,57 | 5,93 | 3,02 | 6,92 | 9,45 | 19,90 | 28,76 | 40,94 | 59,58 |
| IMA-B 5+ | 4,13 | 11,16 | 11,29 | 9,84 | 11,30 | 11,03 | 22,89 | 28,01 | 69,69 |
| IMA-B TOTAL | 2,53 | 8,76 | 7,39 | 8,55 | 10,47 | 15,54 | 26,13 | 34,56 | 66,49 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,77 | 6,78 | 4,95 | 7,60 | 12,55 | 18,47 | 23,45 | 32,82 | 51,09 |
| IDKA 2 | 0,29 | 5,76 | 2,60 | 7,07 | 8,74 | 18,79 | 28,85 | 40,48 | 57,41 |
| IDKA 20 | 7,14 | 15,51 | 20,12 | 11,68 | 12,90 | 1,60 | 17,65 | 14,97 | 73,96 |
| CDI | 1,12 | 5,37 | 3,25 | 6,55 | 13,48 | 22,43 | 25,10 | 31,21 | 39,57 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 3,74 | -1,28 | 3,24 | -3,69 | -2,71 | -14,17 | 23,95 | 11,65 | 41,15 |
| IBRX 100 | 3,59 | -2,09 | 2,36 | -4,66 | -4,47 | -16,34 | 23,50 | 12,48 | 44,21 |
| IBRX 50 | 2,92 | -3,51 | 0,95 | -5,97 | -4,44 | -15,81 | 25,71 | 11,41 | 38,93 |
| SMALL CAP | 13,54 | 4,71 | 13,69 | 1,56 | -7,34 | -32,24 | 6,89 | 5,09 | 34,10 |
| Índice Consumo - ICON | 12,26 | -1,05 | 6,51 | -6,28 | -15,80 | -46,84 | -32,02 | -26,79 | -9,87 |
| Índice Dividendos - IDIV | 0,84 | 0,48 | 2,64 | -1,14 | -0,85 | 1,55 | 39,98 | 32,28 | 81,33 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | 2,16 | 6,32 | 3,02 | -1,39 | 9,00 | -3,17 | 28,94 | 96,40 | 109,24 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | 5,43 | 5,10 | 7,30 | 5,10 | 6,84 | 6,99 | 13,39 | 18,05 | 36,10 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 0,56 | 4,28 | 0,55 | -1,39 | 6,70 | -11,51 | 19,15 | 69,85 | 72,84 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,23 | 2,95 | 1,56 | 3,59 | 3,94 | 16,13 | 25,48 | 27,84 | 33,80 |
| INPC | 0,36 | 2,79 | 1,54 | 3,50 | 3,74 | 16,08 | 26,41 | 29,00 | 35,17 |
| IGPM | -1,84 | -2,58 | -2,73 | -2,14 | -4,47 | 5,78 | 44,96 | 54,39 | 66,19 |
| SELIC | 1,12 | 5,37 | 3,25 | 6,55 | 13,48 | 22,43 | 25,10 | 31,21 | 39,57 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,57 | 4,62 | 2,56 | 5,63 | 8,08 | 25,59 | 41,11 | 49,48 | 62,68 |
| IPCA + 5,00% | 0,66 | 5,03 | 2,80 | 6,13 | 9,11 | 28,01 | 45,21 | 55,30 | 70,63 |
| IPCA + 5,50% | 0,70 | 5,23 | 2,93 | 6,38 | 9,63 | 29,23 | 47,29 | 58,27 | 74,72 |
| IPCA + 5,89% | 0,73 | 5,39 | 3,02 | 6,57 | 10,03 | 30,18 | 48,92 | 60,62 | 77,96 |
| IPCA + 6,00% | 0,74 | 5,43 | 3,05 | 6,63 | 10,15 | 30,45 | 49,38 | 61,28 | 78,88 |
| INPC + 4,00% | 0,70 | 4,45 | 2,54 | 5,53 | 7,87 | 25,54 | 42,15 | 50,84 | 64,35 |
| INPC + 6,00% | 0,87 | 5,27 | 3,03 | 6,53 | 9,94 | 30,40 | 50,49 | 62,75 | 80,72 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

| Ativo | Financeiro Curva (R\$) | Taxa Curva (%) | Financeiro Mercado (R\$) | Taxa Mercado (%) | Diferença (R\$) |
|--------------------------|------------------------|----------------|--------------------------|------------------|-----------------|
| NTN-B 150830 (5,545866%) | 4.085.050,81 | 5,545866 | 4.106.941,25 | 5,450000 | 21.890,44 |
| NTN-B 150830 (5,593447%) | 2.149.141,76 | 5,593447 | 2.166.108,25 | 5,450000 | 16.966,49 |
| NTN-B 150830 (5,775010%) | 8.509.229,66 | 5,775010 | 8.664.433,01 | 5,450000 | 155.203,35 |
| NTN-B 150830 (6,044849%) | 2.095.781,16 | 6,044849 | 2.166.108,25 | 5,450000 | 70.327,09 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|---------------------|------------------|------------------|--------------|
| 203 | 05/05/2023 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 25.000,00 | 9.891,68484417 | 2,5273753050 |
| 204 | 19/05/2023 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 1.579.000,00 | 0,00 | 481.987,86471772 | 3,2760160900 |
| Total | | | 1.579.000,00 | 25.000,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.169.343,13

Value-At-Risk: 1,51%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| IPREMAR | | 1,51 | 1,51 | | | 143.538.310,98 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,27%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| NTN-B 150830 (5,545866%) | | 0,07 | 0,00 | 0,10 | | | 4.085.050,81 | 2,85 |
| NTN-B 150830 (5,593447%) | | 0,07 | 0,00 | 0,11 | | | 2.149.141,76 | 1,50 |
| NTN-B 150830 (5,775010%) | | 0,20 | -0,00 | 0,22 | | | 8.509.229,66 | 5,93 |
| NTN-B 150830 (6,044849%) | | 0,07 | 0,00 | 0,11 | | | 2.095.781,16 | 1,46 |
| Sub-total | 0,30 | 0,11 | -0,00 | | -0,19 | 1,07 | 16.839.203,39 | 11,73 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF IRF M | | 1,39 | 0,04 | 0,02 | | | 5.025.473,65 | 3,50 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | | 0,22 | 0,00 | 0,01 | | | 3.861.528,14 | 2,69 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | | 1,94 | 0,08 | 0,03 | | | 6.019.980,34 | 4,19 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | | 1,96 | 0,01 | 0,01 | | | 921.040,39 | 0,64 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,96 | 0,13 | 0,04 | | | 9.795.023,40 | 6,82 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | | 0,22 | 0,00 | 0,01 | | | 3.855.368,30 | 2,69 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 0,86 | 0,07 | 0,03 | | | 15.068.365,71 | 10,50 |
| BB PREV RF IDKA2 | | 0,99 | 0,04 | 0,16 | | | 7.775.936,55 | 5,42 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | | 3,34 | 0,36 | 0,06 | | | 16.862.830,92 | 11,75 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP | | 2,06 | 0,05 | 0,04 | | | 3.960.054,33 | 2,76 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,01 | 0,03 | 0,16 | | | 5.256.875,95 | 3,66 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | | 0,00 | -0,00 | 0,00 | | | 2.533.357,03 | 1,76 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | | 0,86 | 0,02 | 0,02 | | | 4.577.174,75 | 3,19 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP | | 0,82 | 0,01 | 1,16 | | | 1.262.457,76 | 0,88 |
| Sub-total | 2,12 | 1,45 | 0,84 | | 0,36 | 1,89 | 86.775.467,22 | 60,45 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | | 1,99 | 0,03 | 0,24 | | | 2.167.619,98 | 1,51 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | | 0,82 | 0,00 | 0,02 | | | 769.434,95 | 0,54 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP | | 1,99 | 0,10 | 0,07 | | | 7.489.709,59 | 5,22 |
| BB PREV RF IMA-B | | 1,95 | 0,16 | 0,05 | | | 12.615.686,77 | 8,79 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | | 0,01 | -0,00 | 0,01 | | | 6.612.535,21 | 4,61 |
| Sub-total | 2,46 | 1,50 | 0,29 | | 0,46 | 2,25 | 29.654.986,50 | 20,66 |

Artigo 7º V, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
| SANTOS CREDIT YIELD | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | 21.820,79 | 0,02 |
| Sub-total | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | 21.820,79 | 0,02 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,46%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | | 7,21 | 0,07 | 2,92 | | | 2.085.047,60 | 1,45 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | | 7,27 | 0,18 | 1,89 | | | 4.948.592,04 | 3,45 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | | 8,24 | 0,13 | 0,18 | | | 3.213.193,44 | 2,24 |
| Sub-total | 14,47 | 7,46 | 0,39 | | 0,10 | 2,52 | 10.246.833,08 | 7,14 |