



**CARAGUATATUBA**  
JULHO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 11.08.2020.

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

82,64%

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

| 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 IRF-M                                    | 5,87                   | 1,13               | 5,86               | 16.417.305,04         | 3,32         | 5.350.645.859,80  | 0,31    |
| ITAU                                   | ITAU      | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI                  | 0,53                   | 0,23               | 2,70               | 6.630.447,92          | 1,34         | 210.873.996,61    | 3,14    |
| ITAU                                   | ITAU      | ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI                | 12,43                  | 4,36               | 2,50               | 16.414.876,74         | 3,32         | 371.400.916,61    | 4,42    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,54                   | 0,23               | 2,69               | 13.782.101,69         | 2,78         | 7.835.713.656,67  | 0,18    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | 12,47                  | 4,36               | 1,01               | 15.151.886,42         | 3,06         | 5.823.784.558,48  | 0,26    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 12,54                  | 4,38               | 2,42               | 44.653.070,69         | 9,02         | 6.313.416.954,01  | 0,71    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              | 19,21                  | 7,28               | 1,51               | 25.667.741,75         | 5,19         | 2.088.485.812,29  | 1,23    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP       | 12,52                  | 4,36               | 1,56               | 4.386.480,57          | 0,89         | 1.362.475.594,28  | 0,32    |
| ITAU                                   | ITAU      | ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI                            | 19,16                  | 7,28               | 1,35               | 4.347.927,69          | 0,88         | 85.176.700,12     | 5,10    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 19,32                  | 7,29               | 1,46               | 53.827.105,61         | 10,88        | 2.059.270.796,72  | 2,61    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO                     | 8,70                   | 1,50               | 7,47               | 14.086.163,17         | 2,85         | 3.049.933.927,01  | 0,46    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 4,02                   | 0,83               | 3,97               | 15.594.857,70         | 3,15         | 7.954.778.997,85  | 0,20    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 5,85                   | 1,09               | 5,87               | 4.972.413,76          | 1,00         | 15.544.114.121,31 | 0,03    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF VII                                      | 2,29                   | 0,32               | 1,97               | 1.322.663,89          | 0,27         | 685.876.947,75    | 0,19    |
| CEF                                    | CEF       | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 5,95                   | 0,98               | 5,65               | 20.483.747,60         | 4,14         | 12.451.209.797,34 | 0,16    |
| CEF                                    | CEF       | FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 1,19                   | 0,07               | 0,81               | 50.780.880,00         | 10,26        | 1.000.769.936,56  | 5,07    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |           |                                                     | <b>9,34</b>            | <b>3,32</b>        | <b>2,64</b>        | <b>308.519.670,24</b> | <b>62,33</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 |
|--------|--------|--------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|---------------|------------|------------------|---------|
| ITAU   | ITAU   | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 0,24                   | 0,23               | 1,73               | 5.476.190,04  | 1,11       | 900.006.177,17   | 0,61    |
| ITAU   | ITAU   | ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO                      | 14,27                  | 4,43               | 4,08               | 42.314.021,50 | 8,55       | 579.735.064,46   | 7,30    |
| CEF    | CEF    | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,29                   | 0,25               | 1,62               | 2.076.967,38  | 0,42       | 4.665.137.027,34 | 0,04    |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                  | Admin. | Ativo                                         | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------------|--------|-----------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,64                   | 0,55               | 2,83               | 50.507.371,13         | 10,20        | 5.186.154.771,17 | 0,97    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |        |                                               | <b>6,22</b>            | <b>2,13</b>        | <b>3,09</b>        | <b>100.374.550,05</b> | <b>20,28</b> |                  |         |

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

| Gestor                                   | Admin.   | Ativo              | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)       | % Carteira  | PL do Fundo  | % Fundo |
|------------------------------------------|----------|--------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-------------------|-------------|--------------|---------|
| VILA RICA                                | BRL DTVM | FIDC ITALIA SENIOR | 112,14                 | -0,10              | 10,61              | 106.884,12        | 0,02        | 4.205.147,95 | 2,54    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b> |          |                    | <b>112,14</b>          | <b>-0,10</b>       | <b>10,61</b>       | <b>106.884,12</b> | <b>0,02</b> |              |         |

|                   |  |  |             |             |             |                       |              |  |  |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|--|--|
| <b>Renda Fixa</b> |  |  | <b>8,58</b> | <b>3,02</b> | <b>2,72</b> | <b>409.001.104,41</b> | <b>82,64</b> |  |  |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|--|--|

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,36%

#### Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

| Gestor                                 | Admin. | Ativo                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|----------------------------------------|--------|------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| BB                                     | BB     | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 44,20                  | 8,44               | -10,49             | 22.373.826,96        | 4,52        | 912.996.606,09 | 2,45    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b> |        |                        | <b>44,20</b>           | <b>8,44</b>        | <b>-10,49</b>      | <b>22.373.826,96</b> | <b>4,52</b> |                |         |

#### Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

| Gestor                                  | Admin. | Ativo                                          | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------------|--------|------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRAM                                    | BEM    | BRADESCO F I A SELECTION                       | 43,38                  | 10,05              | -16,95             | 5.180.011,01         | 1,05         | 711.621.761,40   | 0,73    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES DIVIDENDOS                            | 38,20                  | 6,77               | -17,03             | 1.439.925,91         | 0,29         | 972.576.793,16   | 0,15    |
| BRAM                                    | BEM    | BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS            | 43,20                  | 8,23               | -8,64              | 6.261.911,44         | 1,27         | 2.138.402.416,21 | 0,29    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI        | 43,61                  | 8,46               | -9,56              | 14.851.981,97        | 3,00         | 837.484.283,03   | 1,77    |
| VINCI                                   | CEF    | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS            | 41,21                  | 8,86               | -8,47              | 7.131.810,07         | 1,44         | 594.347.288,74   | 1,20    |
| VINCI                                   | CEF    | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 39,01                  | 8,32               | -9,87              | 12.143.194,16        | 2,45         | 862.156.434,48   | 1,41    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI                   | 41,24                  | 9,40               | -8,32              | 11.001.319,10        | 2,22         | 1.826.640.201,67 | 0,60    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                         | 43,06                  | 7,54               | -16,38             | 5.559.845,45         | 1,12         | 3.482.474.100,00 | 0,16    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                                                | <b>41,12</b>           | <b>8,62</b>        | <b>-10,86</b>      | <b>63.569.999,11</b> | <b>12,84</b> |                  |         |

|                                                    |  |  |              |             |               |                       |               |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|-------------|---------------|-----------------------|---------------|--|--|
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |  | <b>41,88</b> | <b>8,58</b> | <b>-10,88</b> | <b>85.943.826,07</b>  | <b>17,36</b>  |  |  |
| <b>Total</b>                                       |  |  |              |             |               | <b>494.944.930,48</b> | <b>100,00</b> |  |  |

## 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 b                       | Fundos 100% Títulos Públicos                      | 308.519.670,24 | 62,33      | 10,00                     | 40,00    | 80,00  | 100,00       |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 100.374.550,05 | 20,28      | 1,00                      | 10,00    | 35,00  | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea a                     | Cota Sênior de FIDC                               | 106.884,12     | 0,02       | 0,01                      | 0,50     | 1,00   | 5,00         |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 409.001.104,41 | 82,64      |                           |          |        |              |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |                           |          |        |              |
| Artigo 8º I, Alinea a                       | Fundos de Ações Referenciados                     | 22.373.826,96  | 4,52       | 10,00                     | 15,00    | 30,00  | 30,00        |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 63.569.999,11  | 12,84      | 10,00                     | 15,00    | 20,00  | 20,00        |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 85.943.826,07  | 17,36      |                           |          |        |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

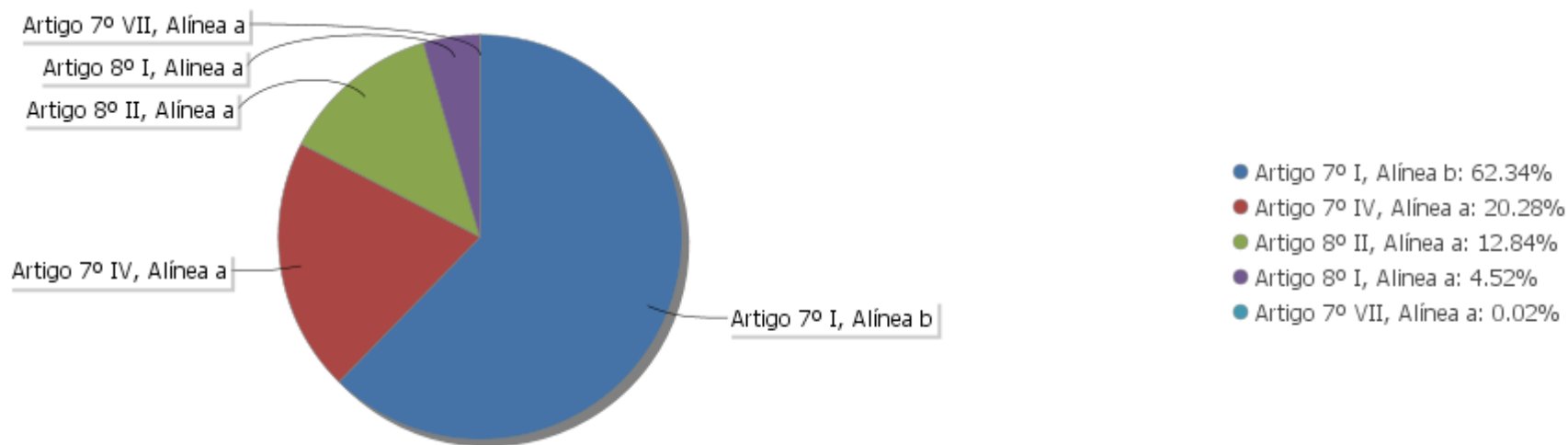
| Estratégia Indexador                         | No Mês           | No Ano          | 3 meses           | 6 meses         | 12 meses        | No Mês(R\$)   | No Ano(R\$)   |
|----------------------------------------------|------------------|-----------------|-------------------|-----------------|-----------------|---------------|---------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | 3,32<br>1.706,17 | 2,64<br>134,99  | 6,25<br>970,82    | 2,32<br>147,57  | 6,87<br>163,01  | 9.930.328,62  | 7.930.721,72  |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 2,13<br>1.094,71 | 3,09<br>158,49  | 4,18<br>649,74    | 2,79<br>177,86  | 6,50<br>154,26  | 2.091.337,91  | 3.152.977,43  |
| Artigo 7º VII, Alínea a<br>% do CDI          | -0,10<br>-48,99  | 10,61<br>543,35 | 25,40<br>3.944,40 | 14,58<br>929,17 | 31,45<br>746,30 | -101,86       | 27.380,77     |
| Artigo 8º I, Alínea a<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   | 3,52<br>2,44    | 1.741.803,09  | -2.623.081,08 |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 8,62<br>0,36     | -10,86<br>0,15  | 25,94<br>-1,90    | -11,42<br>-1,88 | 4,94<br>3,86    | 5.046.733,89  | -5.460.903,40 |
|                                              |                  |                 |                   |                 |                 | 18.810.101,65 | 3.027.095,44  |

### Análise de Liquidez

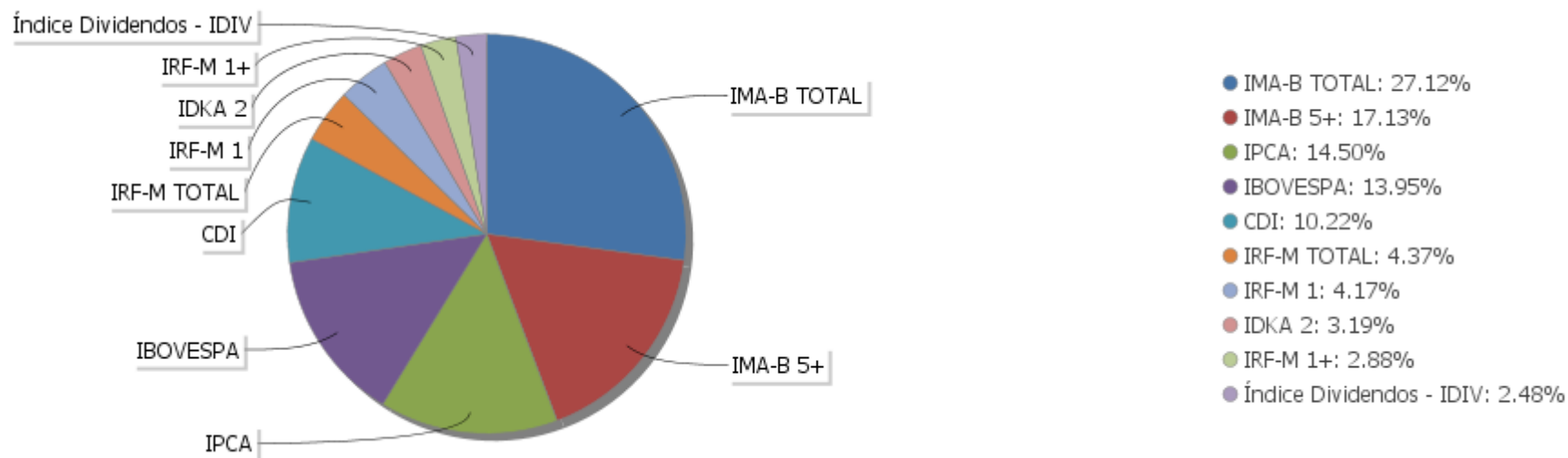
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 457.679.213,69 | 92,47 | 457.679.213,69        | 92,47     |
| de 31 a 364 dias  | 35.836.168,78  | 7,24  | 493.515.382,47        | 99,71     |
| acima de 365 dias | 1.429.548,01   | 0,29  | 494.944.930,48        | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo



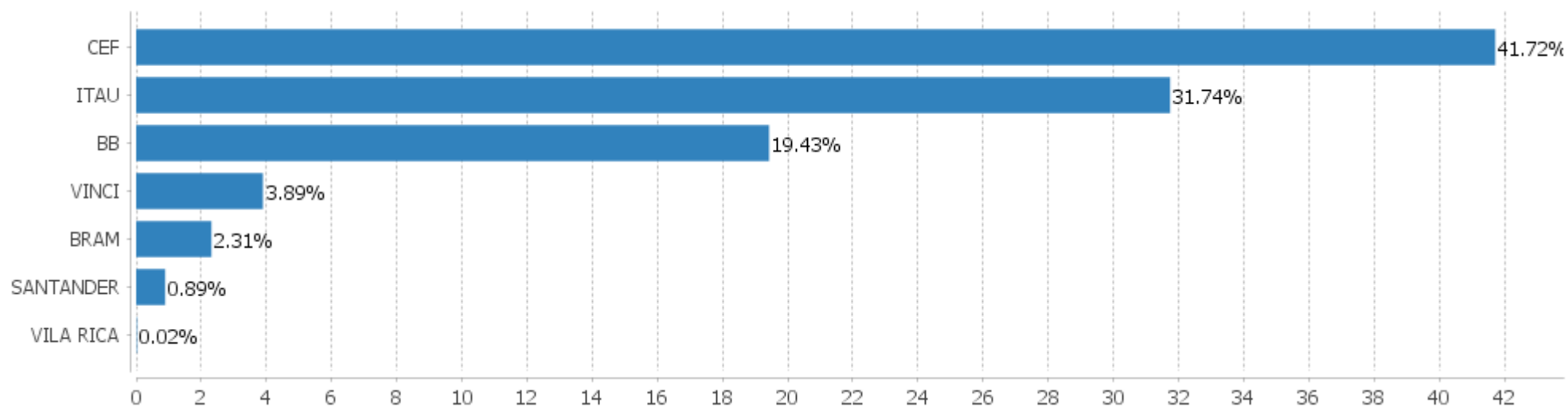
### Alocação Por Estratégia





## 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           | 0,26  | -1,20 | -8,82 | 2,26  | 2,04 | 2,60 | 3,94 |       |      |      |       |      | 0,51     |
| IPCA + 5,89%   | 0,71  | 0,66  | 0,57  | 0,14  | 0,07 | 0,74 | 0,89 |       |      |      |       |      | 3,85     |
| p.p. indexador | -0,45 | -1,86 | -9,40 | 2,11  | 1,97 | 1,86 | 3,06 |       |      |      |       |      | -3,34    |
| 2019           | 1,51  | 0,37  | 0,41  | 0,94  | 1,99 | 2,58 | 1,16 | 0,11  | 1,85 | 2,11 | -0,78 | 2,17 | 15,34    |
| IPCA + 6%      | 0,83  | 0,90  | 1,19  | 1,06  | 0,64 | 0,45 | 0,72 | 0,62  | 0,45 | 0,63 | 0,98  | 1,64 | 10,59    |
| p.p. indexador | 0,68  | -0,53 | -0,78 | -0,12 | 1,35 | 2,13 | 0,44 | -0,51 | 1,40 | 1,47 | -1,75 | 0,52 | 4,75     |

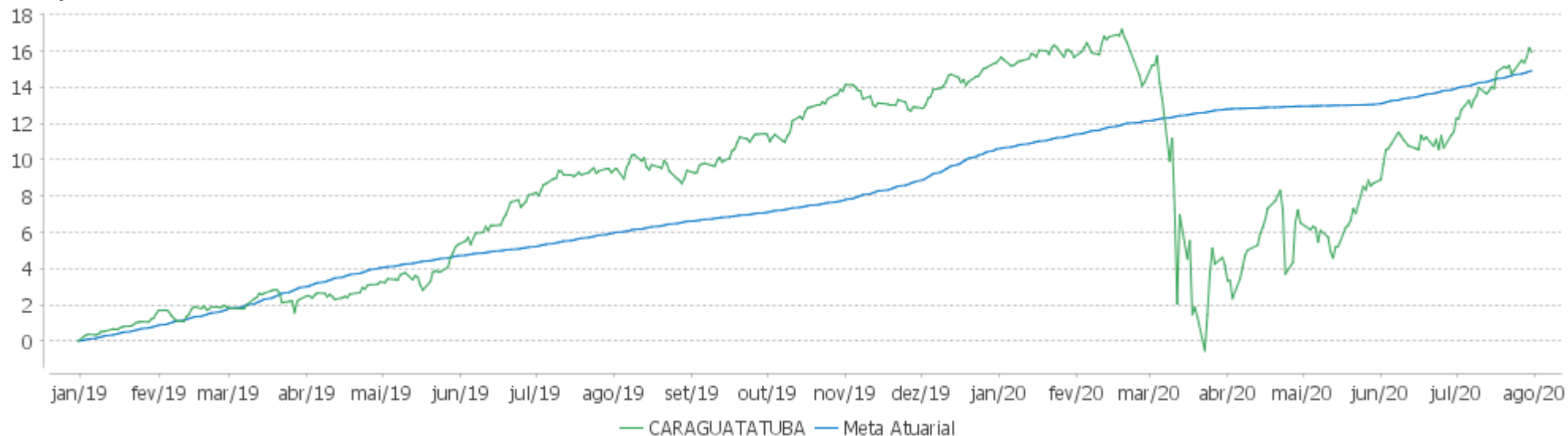
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

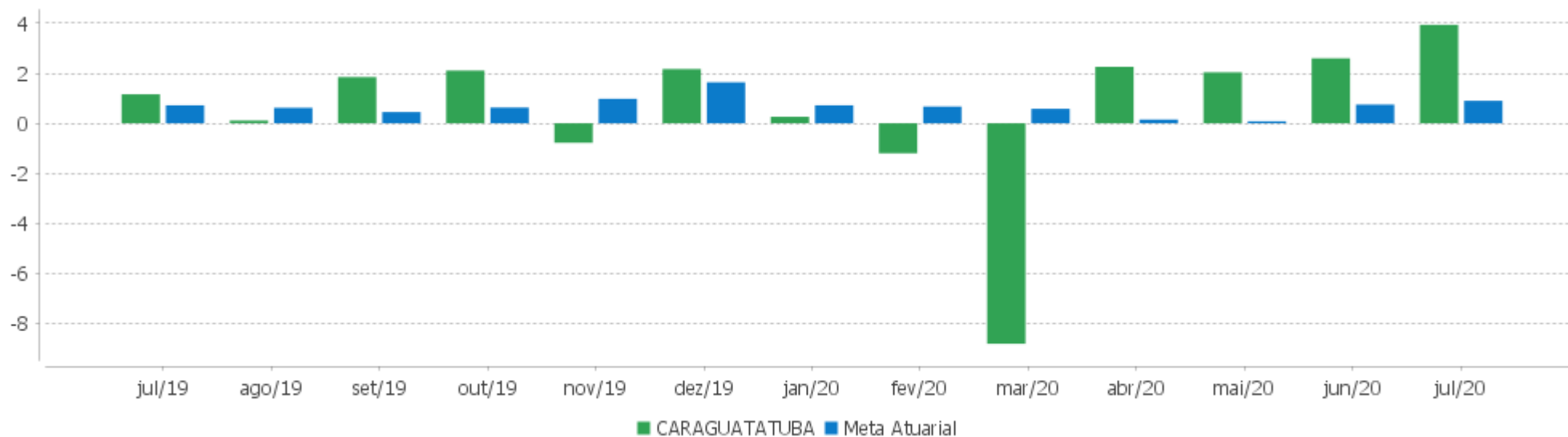
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 11         | 57,89     | 03 meses         | 8,83     | 1,71          | 7,12       | 6,85               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 8          | 42,11     | 06 meses         | 0,24     | 3,11          | -2,87      | 17,53              |
|                                 |            |           | 12 meses         | 6,07     | 8,40          | -2,33      | 12,50              |
|                                 |            |           | 24 meses         |          |               |            |                    |
|                                 |            |           | 36 meses         |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,94       | 2020-07   | Desde 31/12/2018 | 15,93    | 14,84         | 1,08       | 10,12              |
| Menor rentabilidade da Carteira | -8,82      | 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        |
|-------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI<br>% do CDI            | 0,23<br>116,96   | 1,73<br>88,37  | 0,74<br>115,55   | 1,35<br>85,93  | 3,86<br>91,59  | 10,32<br>95,26  | 17,98<br>96,26  |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO<br>% do CDI                                 | 4,43<br>2.281,81 | 4,08<br>209,02 | 8,21<br>1.275,07 | 3,87<br>246,39 | 9,85<br>233,81 | 41,29<br>381,33 | 49,85<br>266,90 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI               | 0,25<br>127,85   | 1,62<br>83,02  | 0,82<br>127,63   | 1,25<br>79,33  | 3,72<br>88,18  | 10,14<br>93,65  | 17,77<br>95,15  |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.         | 0,55<br>0,19     | 2,83<br>2,37   | 1,54<br>1,30     | 2,48<br>2,23   | 5,21<br>2,90   | 19,22<br>13,62  | 29,15<br>18,81  |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.                 | 0,23<br>-0,01    | 2,70<br>-0,15  | 0,91<br>-0,03    | 2,26<br>-0,13  | 5,23<br>-0,28  | 12,70<br>-0,50  | 20,73<br>-0,83  |
| 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  |
| 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  |
| ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI<br>Var. IMA-B 5+ p.p.                          | 7,28<br>-0,05    | 1,35<br>-0,33  | 11,31<br>-0,20   | 1,33<br>-0,31  | 7,32<br>-0,49  | 47,88<br>-1,49  | 53,78<br>-2,41  |
| FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.    | 0,07<br>-4,32    | 0,81<br>-1,84  | 1,77<br>-6,37    | 0,84<br>-1,54  | 4,20<br>-3,95  | 14,12<br>-23,74 | 20,80<br>-25,96 |
| 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  |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | 4,36<br>-0,02    | 2,50<br>-0,15  | 8,01<br>-0,13    | 2,26<br>-0,12  | 7,90<br>-0,26  | 36,89<br>-0,97  | 45,05<br>-1,70  |
| BB PREV RF VII<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                                 | 0,32<br>-4,07    | 1,97<br>-0,68  | 2,58<br>-5,56    | 1,77<br>-0,61  | 5,74<br>-2,41  | 18,19<br>-19,68 | 27,84<br>-18,91 |
| 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                                    | 4,36             | 2,54           | 8,07             | 2,27           | 7,94           | 37,20           | 45,69           |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                | No Mês | No Ano | 3 meses  | 6 meses | 12 meses | 24 meses  | 36 meses     |
|------------------------------------------------|--------|--------|----------|---------|----------|-----------|--------------|
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                          | -0,02  | -0,11  | -0,07    | -0,11   | -0,22    | -0,66     | -1,07        |
| BB PREV RF IRF-M                               | 1,13   | 5,86   | 3,31     | 4,96    | 9,57     | 26,04     | 35,92        |
| Var. IRF-M TOTAL p.p.                          | 0,04   | -0,14  | -0,01    | -0,12   | -0,24    | -0,55     | -0,87        |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI         | 7,28   | 1,51   | 11,38    | 1,46    | 7,68     | 48,58     | 54,96        |
| Var. IMA-B 5+ p.p.                             | -0,05  | -0,16  | -0,12    | -0,18   | -0,13    | -0,79     | -1,23        |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP  | 4,36   | 2,24   | 8,04     | 1,99    | 7,60     | 36,81     | 45,25        |
| Var. IMA-B TOTAL p.p.                          | -0,02  | -0,41  | -0,10    | -0,39   | -0,55    | -1,06     | -1,50        |
| FIDC ITALIA SENIOR                             | -0,10  | 10,61  | 25,40    | 14,58   | 31,45    | 2.567,49  | 219.806,01   |
| % do CDI                                       | -48,99 | 543,35 | 3.944,40 | 929,17  | 746,30   | 23.711,43 | 1.176.915,41 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI                   | 9,40   | -6,63  | 29,38    | -7,80   | 6,25     | 45,40     | 79,22        |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 1,13   | 4,38   | 1,55     | 1,73    | 5,17     | 15,50     | 23,10        |
| BRADESCO F I A SELECTION                       | 10,05  | -16,95 | 29,32    | -15,87  | -6,40    | 22,01     | 57,60        |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 1,78   | -5,94  | 1,49     | -6,33   | -7,48    | -7,90     | 1,49         |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS            | 8,86   | -8,47  | 27,39    | -10,22  | 11,49    | 61,50     | 86,31        |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 0,60   | 2,54   | -0,44    | -0,68   | 10,41    | 31,60     | 30,19        |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                         | 7,54   | -16,38 | 23,81    | -16,23  | -0,92    | 38,66     | 71,08        |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 8,32   | -9,87  | 21,78    | -11,23  | 4,70     | 50,50     | 62,91        |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.             | 1,79   | 3,18   | -0,08    | 0,43    | 1,20     | 4,00      | -0,28        |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI        | 8,46   | -9,56  | 27,16    | -10,16  | 4,36     | 37,47     | 60,62        |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 0,20   | 1,46   | -0,67    | -0,63   | 3,28     | 7,56      | 4,50         |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                            | 6,77   | -17,03 | 19,26    | -16,68  | -7,01    | 24,01     | 35,50        |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | -1,50  | -6,02  | -8,57    | -7,15   | -8,09    | -5,90     | -20,61       |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS            | 8,23   | -8,64  | 24,69    | -10,09  | 9,43     | 58,19     | 87,18        |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | -0,04  | 2,37   | -3,15    | -0,55   | 8,35     | 28,28     | 31,06        |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                         | 8,44   | -10,49 | 27,78    | -9,51   | 3,49     | 35,87     | 54,71        |
| Var. IBOVESPA p.p.                             | 0,18   | 0,52   | -0,05    | 0,03    | 2,41     | 5,97      | -1,40        |
| 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>          |        |        |         |         |          |          |          |

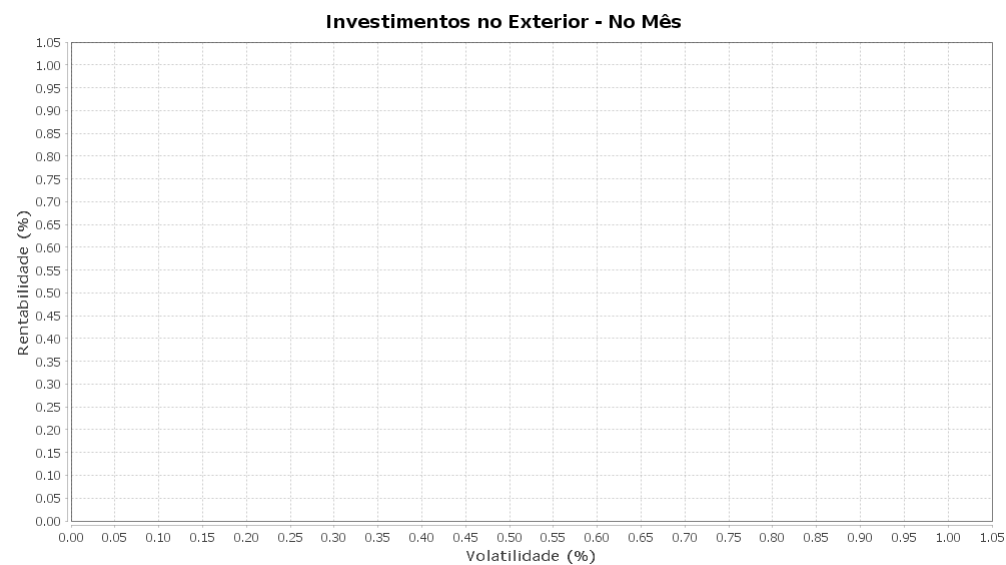
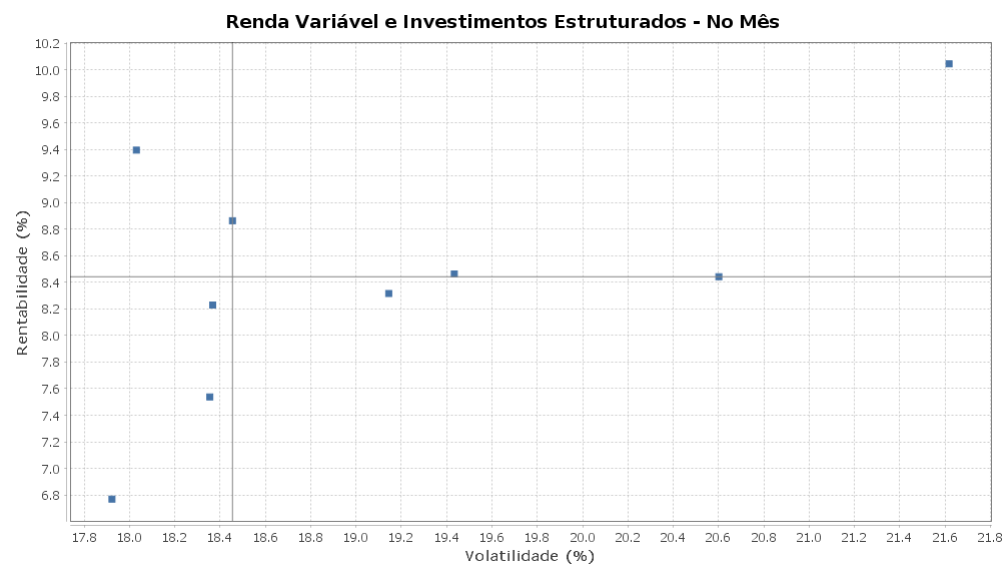
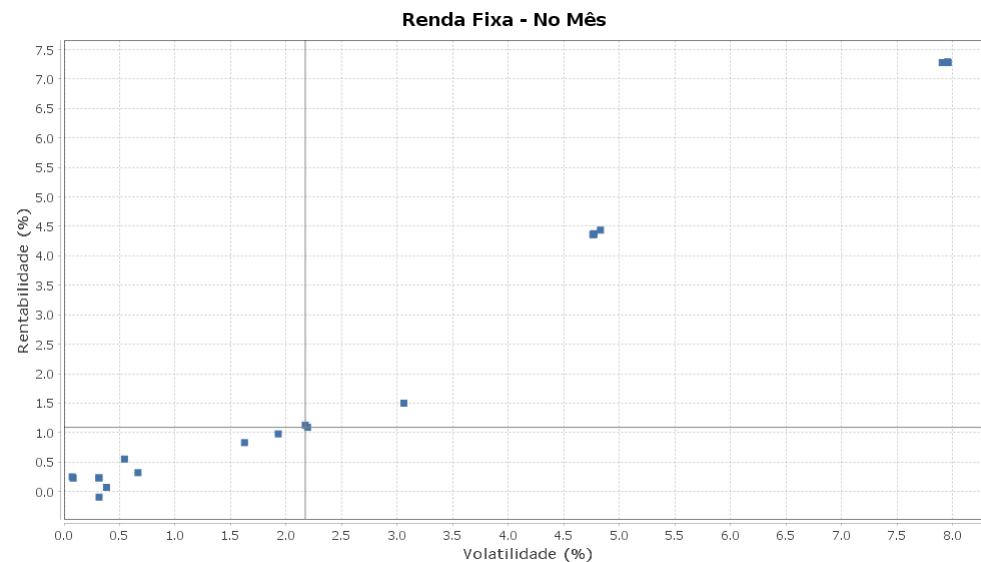
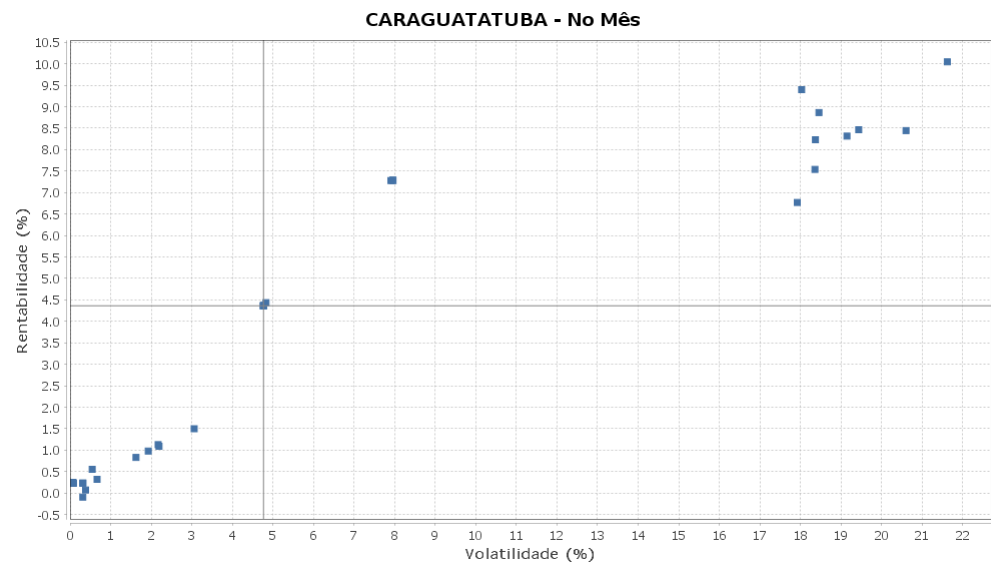
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data       | Ativo                                            | Aplicação    | Resgate      | Quantidade       | Valor Cota       |
|-----|------------|--------------------------------------------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 126 | 06/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI        | 9.232,22     | 0,00         | 3.421,19465300   | 2,6985368960     |
| 127 | 07/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI        | 586.613,92   | 0,00         | 217.393,59918900 | 2,6983955470     |
| 128 | 07/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI        | 1.655,70     | 0,00         | 613,58684100     | 2,6983955470     |
| 129 | 07/07/2020 | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI               | 0,00         | 10.245,47    | 306,42934342     | 33,4350160000    |
| 130 | 07/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,00         | 32.000,00    | 8.641,20316800   | 3,7031880000     |
| 131 | 15/07/2020 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 23.084,14    | 0,00         | 7,30160421       | 3.161,5162000000 |
| 132 | 17/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI        | 1.735,88     | 0,00         | 642,79298000     | 2,7005273140     |
| 133 | 20/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI        | 237.376,18   | 0,00         | 87.892,25740800  | 2,7007632640     |
| 134 | 20/07/2020 | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI               | 1.408.734,87 | 0,00         | 42.101,24041225  | 33,4606500000    |
| 135 | 22/07/2020 | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI               | 0,00         | 263,87       | 7,88664677       | 33,4578190000    |
| 136 | 28/07/2020 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 23.309,34    | 0,00         | 7,36495183       | 3.164,9005350000 |
| 137 | 28/07/2020 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 107.699,72   | 0,00         | 34,02941698      | 3.164,9005350000 |
| 138 | 30/07/2020 | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI               | 0,00         | 2.152.139,99 | 64.241,09206096  | 33,5009870000    |
| 139 | 30/07/2020 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 13.725,88    | 0,00         | 4,33622348       | 3.165,3995850000 |
| 140 | 30/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,00         | 141.983,61   | 38.273,60960300  | 3,7097000000     |
| 141 | 31/07/2020 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 1.264,23     | 0,00         | 0,39932857       | 3.165,8892040000 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                               | Estratégia              | Volatilidade | VaR  | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|-----------------------------------------------------|-------------------------|--------------|------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP       | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,07         | 0,02 | 0,25  | 2.076.967,38  | 0,42       |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI    | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,08         | 0,02 | 0,23  | 5.476.190,04  | 1,11       |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI                  | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,31         | 0,04 | 0,23  | 6.630.447,92  | 1,34       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,31         | 0,04 | 0,23  | 13.782.101,69 | 2,78       |
| FIDC ITALIA SENIOR                                  | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,32         | 0,03 | -0,10 | 106.884,12    | 0,02       |
| FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF         | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,38         | 0,04 | 0,07  | 50.780.880,00 | 10,26      |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI       | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,54         | 0,08 | 0,55  | 50.507.371,13 | 10,20      |
| BB PREV RF VII                                      | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,67         | 0,08 | 0,32  | 1.322.663,89  | 0,27       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,62         | 0,20 | 0,83  | 15.594.857,70 | 3,15       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,93         | 0,24 | 0,98  | 20.483.747,60 | 4,14       |
| BB PREV RF IRF-M                                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,17         | 0,27 | 1,13  | 16.417.305,04 | 3,32       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,19         | 0,27 | 1,09  | 4.972.413,76  | 1,00       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO                     | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,06         | 0,38 | 1,50  | 14.086.163,17 | 2,85       |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI                | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,76         | 0,68 | 4,36  | 16.414.876,74 | 3,32       |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,76         | 0,68 | 4,36  | 15.151.886,42 | 3,06       |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP       | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,77         | 0,68 | 4,36  | 4.386.480,57  | 0,89       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,77         | 0,68 | 4,38  | 44.653.070,69 | 9,02       |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO                         | Artigo 7º IV, Alínea a  | 4,83         | 0,69 | 4,43  | 42.314.021,50 | 8,55       |
| ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI                            | Artigo 7º I, Alínea b   | 7,91         | 1,12 | 7,28  | 4.347.927,69  | 0,88       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | Artigo 7º I, Alínea b   | 7,95         | 1,13 | 7,29  | 53.827.105,61 | 10,88      |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              | Artigo 7º I, Alínea b   | 7,96         | 1,13 | 7,28  | 25.667.741,75 | 5,19       |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 17,92        | 2,14 | 6,77  | 1.439.925,91  | 0,29       |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI                        | Artigo 8º II, Alínea a  | 18,03        | 2,26 | 9,40  | 11.001.319,10 | 2,22       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                              | Artigo 8º II, Alínea a  | 18,35        | 2,22 | 7,54  | 5.559.845,45  | 1,12       |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 18,37        | 2,25 | 8,23  | 6.261.911,44  | 1,27       |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 18,45        | 2,28 | 8,86  | 7.131.810,07  | 1,44       |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS      | Artigo 8º II, Alínea a  | 19,14        | 2,33 | 8,32  | 12.143.194,16 | 2,45       |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI             | Artigo 8º II, Alínea a  | 19,43        | 2,37 | 8,46  | 14.851.981,97 | 3,00       |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA FI                              | Artigo 8º I, Alínea a   | 20,60        | 2,49 | 8,44  | 22.373.826,96 | 4,52       |
| BRADESCO F I A SELECTION                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 21,62        | 2,66 | 10,05 | 5.180.011,01  | 1,05       |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

No respectivo mês de julho de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso I, Alínea A (4,52% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.