



LDB
EMPRESAS

LINHARES
AGOSTO 2019



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 20.03.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 96,33%

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 150535 (4,410000%) | 4,89 | 4,80 | 6,87 | 963.336,81 | 0,36 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 4,89 | 4,80 | 6,87 | 963.336,81 | 0,36 |

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 |
|--|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B | 7,82 | -2,12 | 21,31 | 32.474.287,32 | 12,02 | 296.357.545,98 | 10,96 |
| BB | BB | BB PREVID RF IRF-M1 | 0,30 | 0,52 | 4,47 | 12.423.167,36 | 4,60 | 8.046.457.805,40 | 0,15 |
| BB | BB | BB PREV IMAB TPB | 5,21 | -0,42 | 16,02 | 15.834.413,87 | 5,86 | 5.956.790.005,56 | 0,27 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 5,22 | -0,42 | 16,06 | 29.313.367,45 | 10,85 | 11.125.833.388,91 | 0,26 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF | 0,29 | 0,52 | 4,50 | 25.437.995,92 | 9,42 | 11.397.966.980,21 | 0,22 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 2,17 | 0,03 | 8,22 | 8.734.582,33 | 3,23 | 9.951.491.659,11 | 0,09 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 1,53 | 0,05 | 6,86 | 5.754.932,03 | 2,13 | 7.650.717.820,55 | 0,08 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP | 3,64 | 0,05 | 9,55 | 2.039.937,13 | 0,76 | 2.212.647.721,38 | 0,09 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP | 1,55 | 0,10 | 7,06 | 8.538.937,58 | 3,16 | 8.720.480.025,40 | 0,10 |
| BB | BB | BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2,16 | 0,03 | 8,23 | 5.882.659,89 | 2,18 | 4.148.984.501,98 | 0,14 |
| BANESTES | BANESTES | Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 | 1,37 | 0,47 | 7,56 | 14.298.132,88 | 5,29 | 134.819.071,61 | 10,61 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | 2,75 | 0,09 | 9,16 | 3.816.323,77 | 1,41 | 535.174.216,41 | 0,71 |
| BB | BB | BB PREV ALOC FIC | 2,55 | 0,08 | 9,42 | 10.989.433,43 | 4,07 | 7.645.235.508,15 | 0,14 |
| CEF | CEF | FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | 3,64 | -0,13 | 12,00 | 1.173.176,29 | 0,43 | 7.692.574.586,28 | 0,02 |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 2,22 | 0,23 | 5,37 | 813.486,34 | 0,30 | 989.161.439,06 | 0,08 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 2,33 | -0,34 | 10,90 | 177.524.833,59 | 65,73 | | |

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|--------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | Banestes Institucional FI Renda Fixa | 7,28 | -1,92 | 20,65 | 15.358.552,76 | 5,69 | 280.557.317,86 | 5,47 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 7,28 | -1,92 | 20,65 | 15.358.552,76 | 5,69 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|----------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,35 | 0,81 | 4,41 | 18.831.445,12 | 6,97 | 499.703.072,02 | 3,77 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 0,06 | 0,49 | 4,15 | 1.095.705,36 | 0,41 | 2.501.222.353,05 | 0,04 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,02 | 0,49 | 4,09 | 11.630.769,63 | 4,31 | 5.099.528.393,28 | 0,23 |
| BB | BB | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,03 | 0,49 | 4,08 | 28.313.671,42 | 10,48 | 3.076.803.846,63 | 0,92 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF | 2,57 | 0,62 | 11,70 | 6.462.821,52 | 2,39 | 85.911.145,84 | 7,52 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,16 | 0,60 | 4,51 | 66.334.413,05 | 24,56 | | |
| Renda Fixa | | | 1,87 | -0,18 | 9,52 | 260.181.136,21 | 96,33 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,67%

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 |
|---|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| CEF | CEF | FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS | 15,52 | 0,72 | 9,31 | 1.639.607,71 | 0,61 | 102.120.593,48 | 1,61 |
| VINCI | CEF | FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 18,11 | 1,86 | 24,57 | 3.025.409,77 | 1,12 | 725.340.569,80 | 0,42 |
| BANESTES | BANESTES | Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | 19,34 | 1,92 | 25,00 | 4.305.885,50 | 1,59 | 80.817.098,52 | 5,33 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 16,40 | 1,68 | 24,29 | 8.970.902,98 | 3,32 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------|----------------|---------|
| CEF | CEF | FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | 6,11 | 0,29 | 7,31 | 945.069,17 | 0,35 | 800.773.149,48 | 0,12 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 6,11 | 0,29 | 7,31 | 945.069,17 | 0,35 | | |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--|--------------|-------------|--------------|-----------------------|---------------|--|--|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 14,81 | 1,55 | 19,06 | 9.915.972,15 | 3,67 | | |
| Total | | | | | | 270.097.108,36 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 963.336,81 | 0,36 | 0,50 | 10,00 | 75,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 177.524.833,59 | 65,73 | 40,00 | 56,00 | 75,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa Referenciados | 15.358.552,76 | 5,69 | 5,00 | 10,00 | 25,00 | 60,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 66.334.413,05 | 24,56 | 10,00 | 20,00 | 40,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 260.181.136,21 | 96,33 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 8.970.902,98 | 3,32 | 0,00 | 2,00 | 5,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 945.069,17 | 0,35 | 0,00 | 2,00 | 5,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 9.915.972,15 | 3,67 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

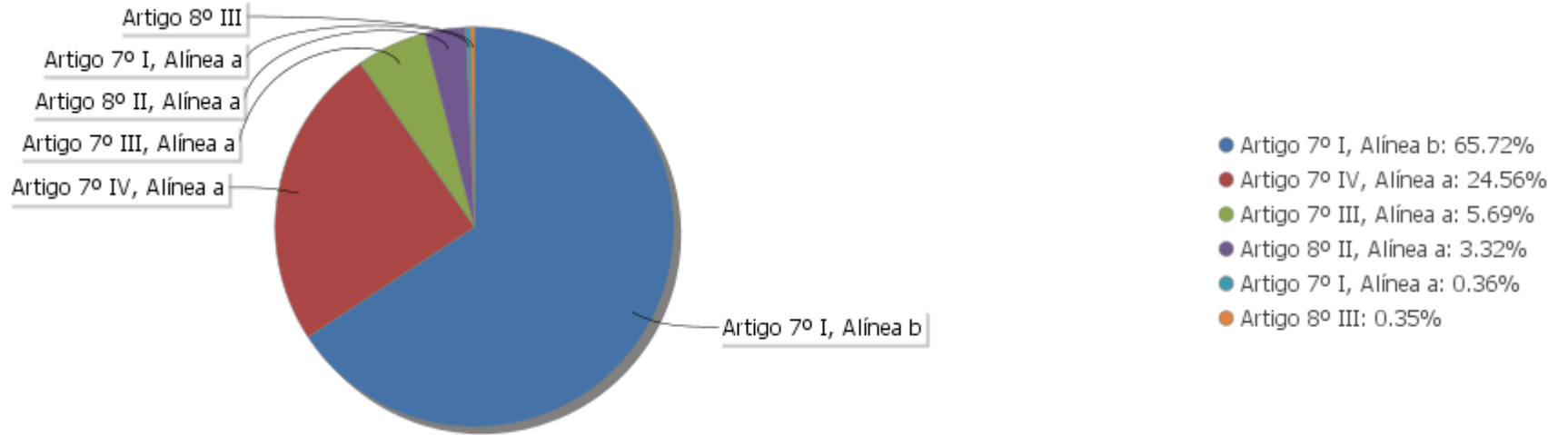
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|------------------|-----------------|----------------|-----------------|----------|-------------|---------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 4,80 957,18 | 6,87 302,14 | 5,70 368,36 | | | 44.142,37 | 62.101,02 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | -0,34 -67,90 | 10,90 260,85 | 3,52 227,67 | 7,79 250,57 | | -605.528,51 | 17.166.015,81 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | -1,92 -383,29 | 20,65 494,15 | 5,86 378,96 | 13,56 436,19 | | -301.136,31 | 2.629.058,16 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,60 118,72 | 4,51 107,91 | 1,74 112,85 | 3,40 109,41 | | 393.765,63 | 2.932.493,34 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 1,68 2,34 | 24,29 9,21 | 9,83 5,60 | 13,20 7,39 | | 148.176,10 | 1.343.877,99 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 0,29 0,96 | 7,31 -7,76 | 2,42 -1,81 | 4,13 -1,68 | | 2.775,83 | 64.367,90 |
| | | | | | | -317.804,89 | 24.197.914,22 |

Análise de Liquidez

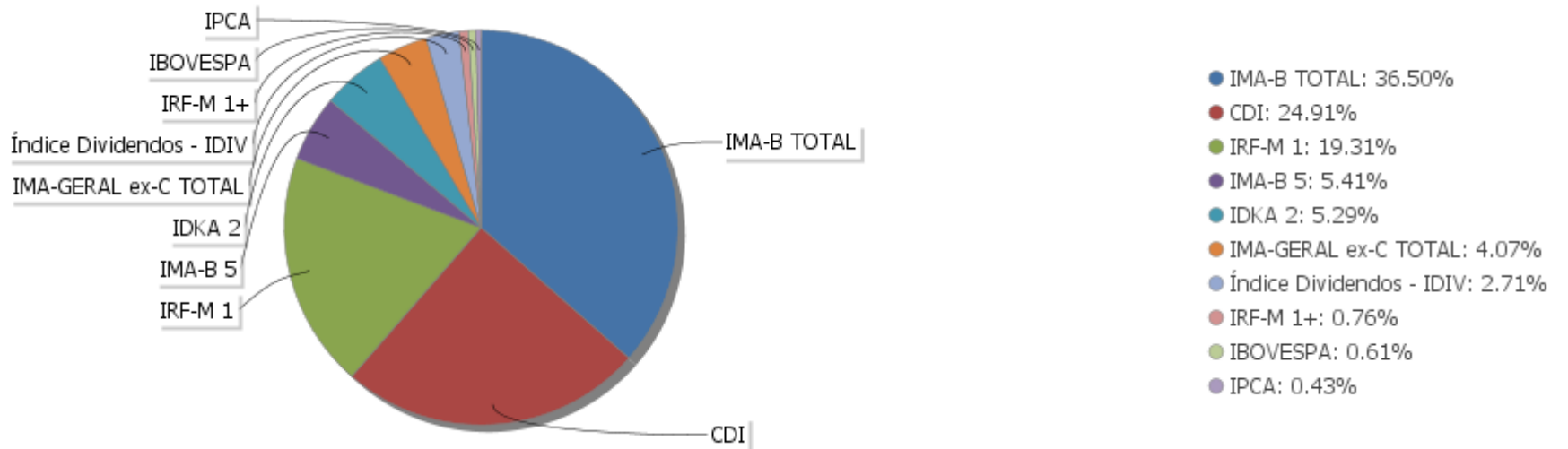
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 257.172.666,17 | 95,21 | 257.172.666,17 | 95,21 |
| de 31 a 364 dias | 8.144.781,61 | 3,02 | 265.317.447,78 | 98,23 |
| acima de 365 dias | 4.779.660,58 | 1,77 | 270.097.108,36 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

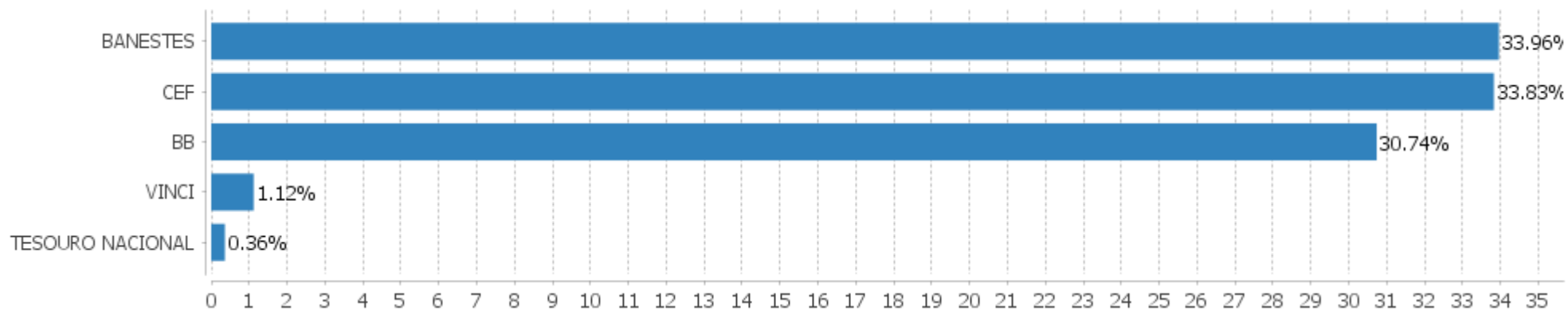


Alocação Por Estratégia



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 |
|----------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|------|------|------|----------|
| 2019 | 2,03 | 0,57 | 0,45 | 0,98 | 2,17 | 2,28 | 1,23 | -0,12 | | | | | 9,99 |
| INPC + 6% | 0,87 | 1,01 | 1,21 | 1,09 | 0,66 | 0,45 | 0,63 | 0,63 | | | | | 6,75 |
| p.p. indexador | 1,15 | -0,43 | -0,77 | -0,11 | 1,51 | 1,83 | 0,60 | -0,75 | | | | | 3,24 |
| 2018 | 3,06 | 0,59 | 0,52 | 0,09 | -2,34 | -0,08 | 1,29 | 0,01 | 0,40 | 3,08 | 0,67 | 1,06 | 8,56 |
| INPC + 6% | 0,74 | 0,60 | 0,56 | 0,70 | 0,92 | 1,92 | 0,76 | 0,53 | 0,74 | 0,91 | 0,21 | 0,60 | 9,59 |
| p.p. indexador | 2,32 | -0,01 | -0,04 | -0,60 | -3,25 | -2,00 | 0,53 | -0,53 | -0,34 | 2,17 | 0,46 | 0,46 | -1,03 |

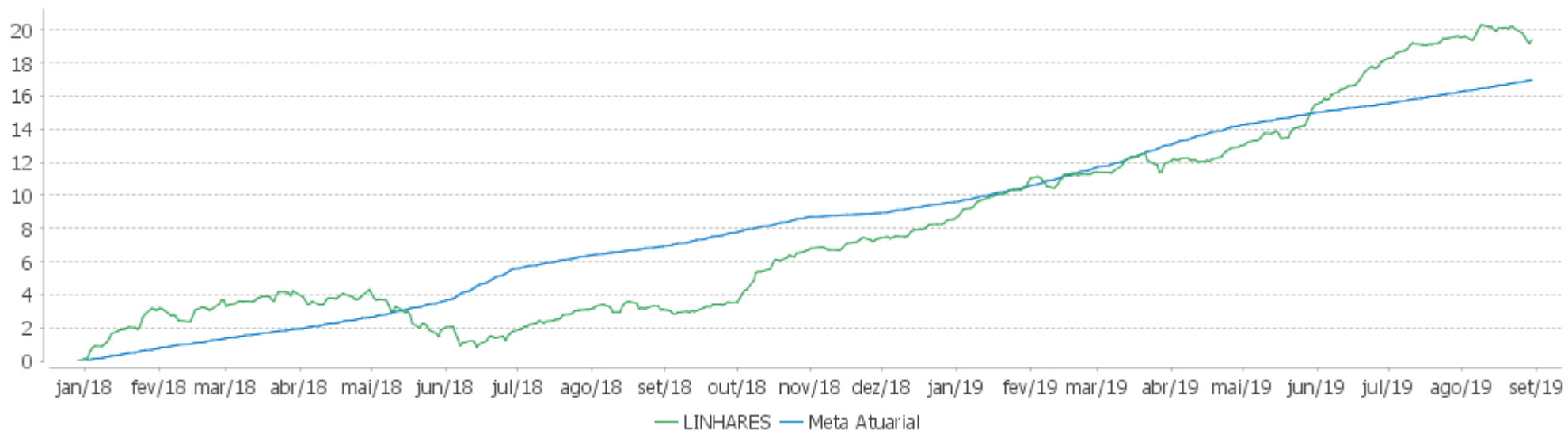
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

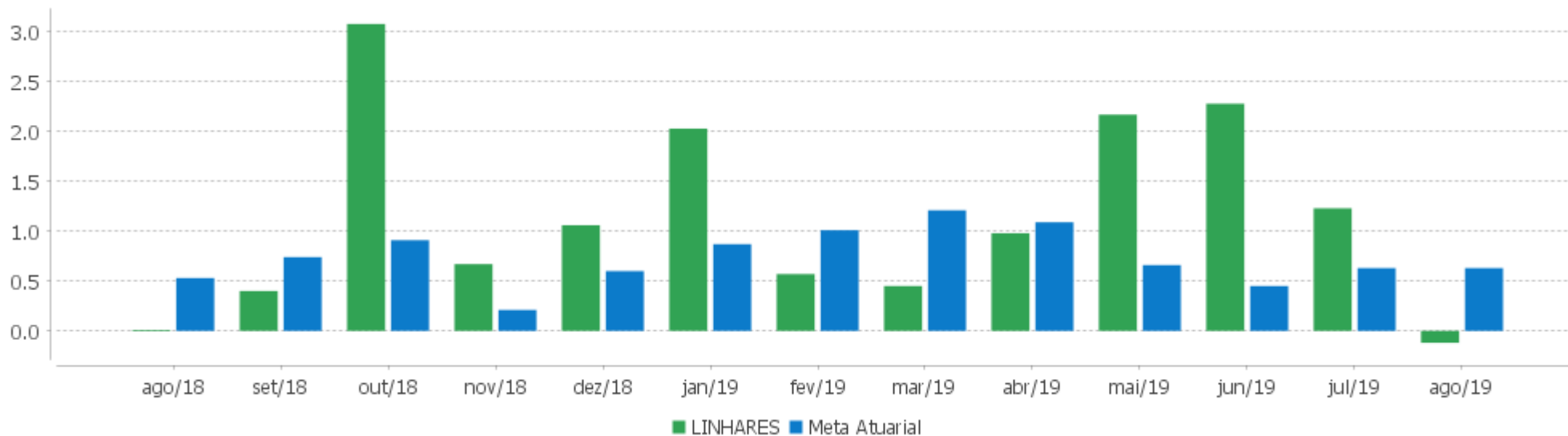
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 9 | 45,00 | 03 meses | 3,42 | 1,72 | 1,70 | 1,99 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 11 | 55,00 | 06 meses | 7,19 | 4,77 | 2,42 | 2,14 |
| | | | 12 meses | 15,81 | 9,41 | 6,40 | 1,96 |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,08 | 2018-10 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -2,34 | 2018-05 | Desde 29/12/2017 | 19,40 | 16,98 | 2,42 | 2,36 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|----------------|---------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,42 -0,02 | 16,06 -0,16 | 4,57 -0,08 | 10,60 -0,15 | 27,30 -0,23 | 32,79 -0,56 | 53,22 -0,79 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p. | 0,03 -0,01 | 8,22 -0,16 | 2,70 -0,06 | 6,03 -0,13 | 14,23 -0,20 | 21,57 -0,48 | 38,25 -0,77 |
| BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p. | 0,52 -0,03 | 4,47 -0,16 | 1,80 -0,06 | 3,42 -0,13 | 7,19 -0,21 | 14,31 -0,50 | 29,03 -0,88 |
| BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,03 -0,02 | 8,23 -0,15 | 2,72 -0,04 | 6,06 -0,10 | 14,19 -0,24 | 21,56 -0,49 | 38,25 -0,77 |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,09 0,49 | 9,16 -7,06 | 2,95 -1,70 | 6,67 -4,08 | 16,27 -11,26 | 23,12 -10,23 | 41,81 -12,20 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,23 0,64 | 5,37 -10,85 | 1,59 -3,06 | 3,71 -7,04 | 9,61 -17,92 | 18,11 -15,24 | 27,91 -26,10 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p. | 0,05 -0,05 | 9,55 -0,28 | 4,07 -0,05 | 7,54 -0,21 | 20,31 -0,14 | 26,46 -0,61 | 51,33 -1,06 |
| Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 Var. IRF-M 1 p.p. | 0,47 -0,08 | 7,56 2,92 | 3,32 1,47 | 6,27 2,73 | 11,64 4,24 | 19,57 4,76 | 36,02 6,11 |
| BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p. | -2,12 -1,72 | 21,31 5,09 | 5,63 0,99 | 13,50 2,74 | 36,77 9,24 | 39,34 5,99 | 60,20 6,20 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 0,05 -0,03 | 6,86 -0,57 | 2,15 -0,20 | 4,94 -0,59 | 11,84 -0,75 | 19,96 -1,67 | 35,90 -3,17 |
| BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,08 -0,09 | 9,42 0,48 | 3,30 0,21 | 6,85 0,42 | 16,13 0,53 | 22,79 0,36 | 40,69 -0,60 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p. | -0,13 -0,24 | 12,00 9,47 | 3,74 3,43 | 8,33 6,55 | 16,60 13,18 | 23,55 15,78 | |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,10 0,02 | 7,06 -0,36 | 2,25 -0,10 | 5,13 -0,39 | 11,98 -0,61 | 20,25 -1,39 | 36,19 -2,87 |
| BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,42 -0,01 | 16,02 -0,20 | 4,60 -0,05 | 10,63 -0,13 | 27,17 -0,36 | 32,66 -0,69 | 52,84 -1,16 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,52 -0,02 | 4,50 -0,13 | 1,81 -0,05 | 3,45 -0,10 | 7,24 -0,17 | 14,42 -0,39 | 29,25 -0,66 |
| NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,80 5,20 | 10,09 -6,13 | 5,70 1,05 | 8,66 -2,10 | 9,64 -17,88 | | |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,81 | 4,41 | 1,80 | 3,36 | 6,42 | 13,54 | 27,72 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| % do CDI | 162,09 | 105,51 | 116,61 | 108,02 | 102,27 | 100,02 | 101,84 |
| BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF | 0,62 | 11,70 | 4,39 | 8,78 | 18,32 | | |
| % do CDI | 122,90 | 279,97 | 283,93 | 282,40 | 291,89 | | |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,49 | 4,08 | 1,51 | 3,03 | 6,16 | 13,44 | 27,24 |
| % do CDI | 98,23 | 97,69 | 97,46 | 97,65 | 98,11 | 99,25 | 100,08 |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 0,49 | 4,15 | 1,54 | 3,11 | 6,20 | 13,25 | 26,81 |
| % do CDI | 97,70 | 99,21 | 99,50 | 100,11 | 98,83 | 97,87 | 98,51 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,49 | 4,09 | 1,50 | 3,04 | 6,12 | 13,21 | 26,89 |
| % do CDI | 97,66 | 97,78 | 97,13 | 97,85 | 97,56 | 97,58 | 98,79 |
| Banestes Institucional FI Renda Fixa | -1,92 | 20,65 | 5,86 | 13,56 | 34,39 | 36,56 | 57,93 |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -1,52 | 4,43 | 1,21 | 2,80 | 6,86 | 3,22 | 3,92 |
| Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | 1,92 | 25,00 | 11,77 | 18,36 | 53,60 | 59,10 | 76,91 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -0,30 | 0,34 | 3,44 | 5,23 | 3,35 | 8,41 | -24,20 |
| FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS | 0,72 | 18,45 | 7,85 | 7,86 | 41,81 | 35,60 | 53,70 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,39 | 3,38 | 3,62 | 2,05 | 9,92 | -7,17 | -20,96 |
| FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 1,86 | 24,57 | 8,90 | 10,56 | 50,41 | 48,80 | 75,50 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -0,37 | -0,09 | 0,58 | -2,56 | 0,15 | -1,89 | -25,60 |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | 0,29 | 7,31 | 2,42 | 4,13 | 13,09 | 20,78 | 37,72 |
| % do CDI | 58,72 | 174,87 | 156,44 | 132,78 | 208,57 | 153,47 | 138,61 |
| CDI | 0,50 | 4,18 | 1,55 | 3,11 | 6,28 | 13,54 | 27,22 |
| IBOVESPA | -0,67 | 15,07 | 4,23 | 5,81 | 31,90 | 42,77 | 74,67 |
| INPC + 6% | 0,63 | 6,75 | 1,72 | 4,77 | 9,41 | 20,14 | 29,52 |
| IPCA + 6% | 0,62 | 6,60 | 1,81 | 4,78 | 9,56 | 20,95 | 31,32 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Renda Fixa | | | | | | | |
| IRF-M 1 | 0,55 | 4,63 | 1,86 | 3,55 | 7,40 | 14,81 | 29,91 |
| IRF-M 1+ | 0,10 | 9,83 | 4,13 | 7,74 | 20,45 | 27,07 | 52,39 |
| IRF-M TOTAL | 0,26 | 8,42 | 3,54 | 6,63 | 16,67 | 23,59 | 45,83 |
| IMA-B 5 | 0,05 | 8,38 | 2,76 | 6,16 | 14,43 | 22,05 | 39,02 |
| IMA-B 5+ | -0,77 | 22,00 | 5,82 | 13,81 | 38,20 | 41,83 | 65,16 |
| IMA-B TOTAL | -0,40 | 16,22 | 4,65 | 10,75 | 27,53 | 33,35 | 54,00 |
| IMA-C TOTAL | -0,10 | 15,25 | 5,58 | 10,92 | 23,44 | 40,03 | 48,37 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,17 | 8,94 | 3,09 | 6,43 | 15,60 | 22,43 | 41,29 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,16 | 9,12 | 3,16 | 6,56 | 15,82 | 22,91 | 41,39 |
| IDKA 2 | 0,08 | 7,42 | 2,35 | 5,52 | 12,59 | 21,63 | 39,06 |
| IDKA 20 | -1,35 | 33,25 | 7,26 | 19,22 | 60,19 | 59,12 | 88,08 |
| CDI | 0,50 | 4,18 | 1,55 | 3,11 | 6,28 | 13,54 | 27,22 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | -0,67 | 15,07 | 4,23 | 5,81 | 31,90 | 42,77 | 74,67 |
| IBRX 100 | -0,16 | 16,75 | 5,14 | 7,34 | 34,86 | 44,77 | 77,28 |
| IBRX 50 | -1,03 | 13,42 | 3,48 | 4,47 | 29,07 | 40,12 | 70,94 |
| SMALL CAP | 0,48 | 27,92 | 14,76 | 19,08 | 51,06 | 47,54 | 101,51 |
| IFIX | -0,11 | 12,97 | 4,07 | 9,12 | 24,18 | 27,48 | 50,34 |
| Índice Consumo - ICON | 4,48 | 38,69 | 18,86 | 29,04 | 51,42 | 35,01 | 54,65 |
| Índice Dividendos - IDIV | 2,23 | 24,66 | 8,32 | 13,12 | 50,25 | 50,69 | 101,10 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,11 | 2,54 | 0,31 | 1,77 | 3,43 | 7,77 | 10,41 |
| INPC | 0,12 | 2,68 | 0,23 | 1,76 | 3,28 | 7,05 | 8,90 |
| IGPM | -0,67 | 4,11 | 0,53 | 3,19 | 4,96 | 14,32 | 12,35 |
| SELIC | 0,50 | 4,18 | 1,54 | 3,11 | 6,28 | 13,55 | 27,25 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |
| IPCA + 4% | 0,45 | 5,25 | 1,31 | 3,79 | 7,52 | 16,47 | 24,08 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IPCA + 5% | 0,54 | 5,93 | 1,56 | 4,28 | 8,54 | 18,70 | 27,67 |
| IPCA + 5,5% | 0,58 | 6,26 | 1,68 | 4,53 | 9,05 | 19,82 | 29,49 |
| IPCA + 5,89% | 0,61 | 6,52 | 1,78 | 4,73 | 9,45 | 20,70 | 30,92 |
| IPCA + 6% | 0,62 | 6,60 | 1,81 | 4,78 | 9,56 | 20,95 | 31,32 |
| INPC + 4% | 0,46 | 5,40 | 1,23 | 3,78 | 7,37 | 15,69 | 22,38 |
| INPC + 6% | 0,63 | 6,75 | 1,72 | 4,77 | 9,41 | 20,14 | 29,52 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

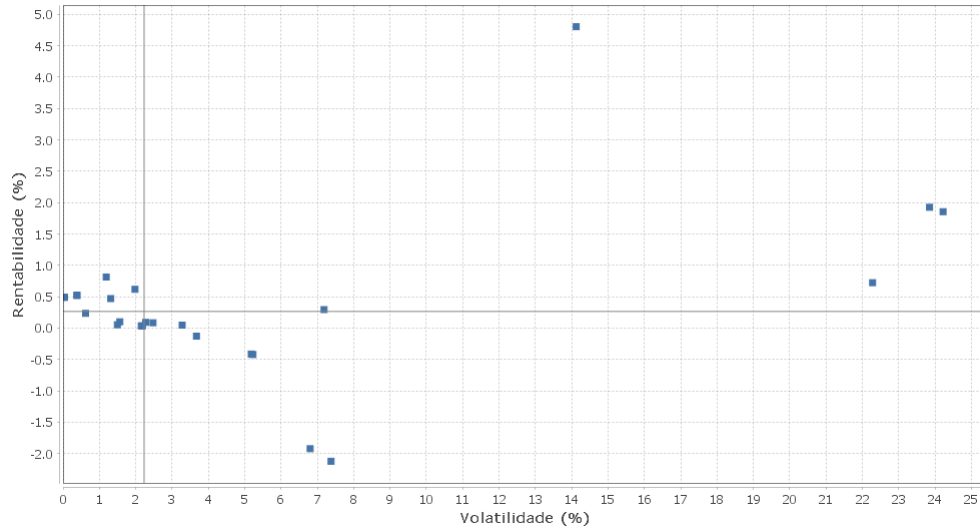
Movimentações

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|---|--------------|-----------|------------------|---------------|
| 07/08/2019 | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,00 | 70.445,43 | 3.588,17060795 | 19,6326868800 |
| 13/08/2019 | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,00 | 21.982,02 | 1.114,91831289 | 19,7162624800 |
| 13/08/2019 | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,00 | 12.286,19 | 623,15005262 | 19,7162624800 |
| 15/08/2019 | BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | 0,00 | 98.285,18 | 56.007,76054326 | 1,7548493100 |
| 23/08/2019 | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,00 | 63.607,51 | 3.220,90925770 | 19,7483086000 |
| 27/08/2019 | BB PREVID RF IRF-M1 | 1.088.305,66 | 0,00 | 421.577,83812988 | 2,5815058600 |
| 29/08/2019 | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,00 | 4.514,38 | 228,39471568 | 19,7657128200 |
| 29/08/2019 | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,00 | 17.652,60 | 893,09193833 | 19,7657128200 |
| 29/08/2019 | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,00 | 57.730,69 | 2.920,74920547 | 19,7657128200 |
| 29/08/2019 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF | 138.404,31 | 0,00 | 55.996,63626058 | 2,4716540000 |
| 30/08/2019 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 1.399,83 | 424,53735730 | 3,2973070000 |

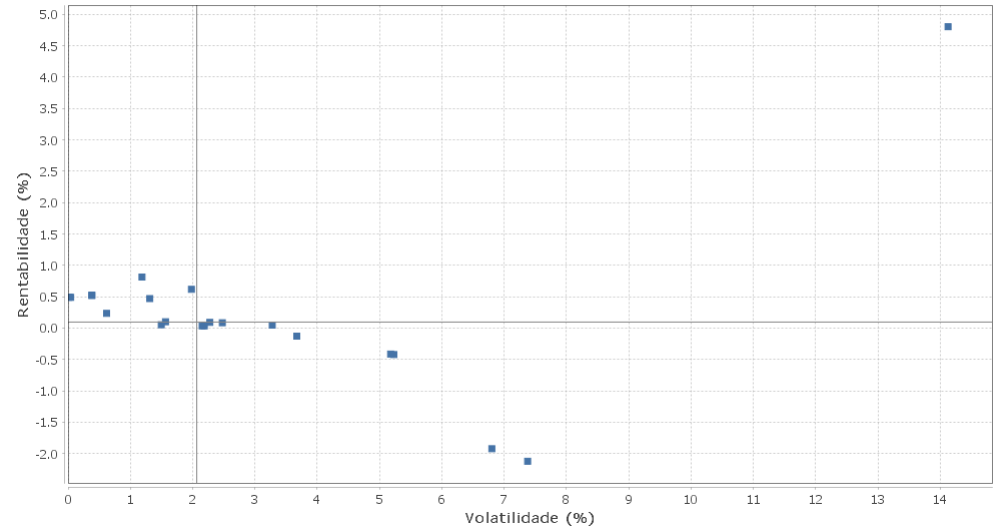
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

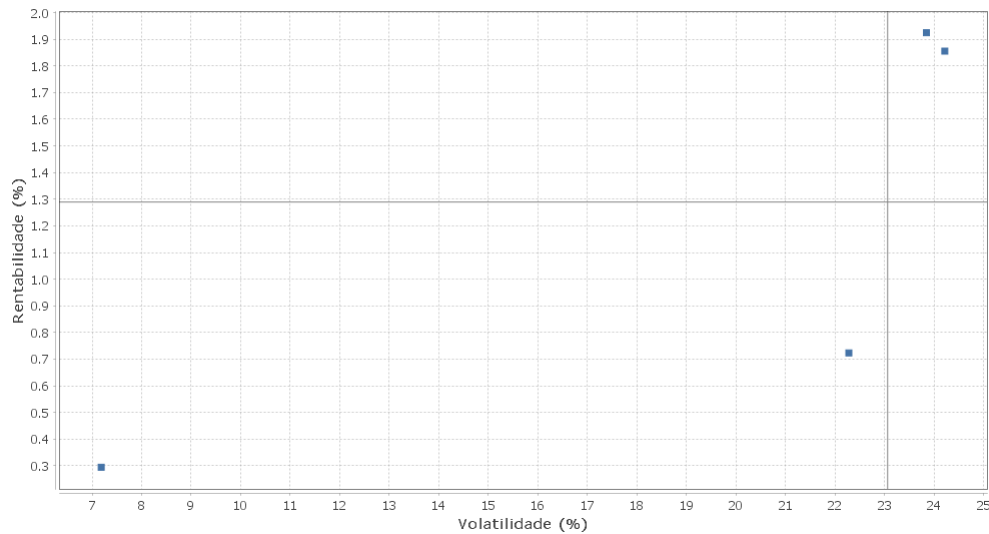
LINHARES - No Mês



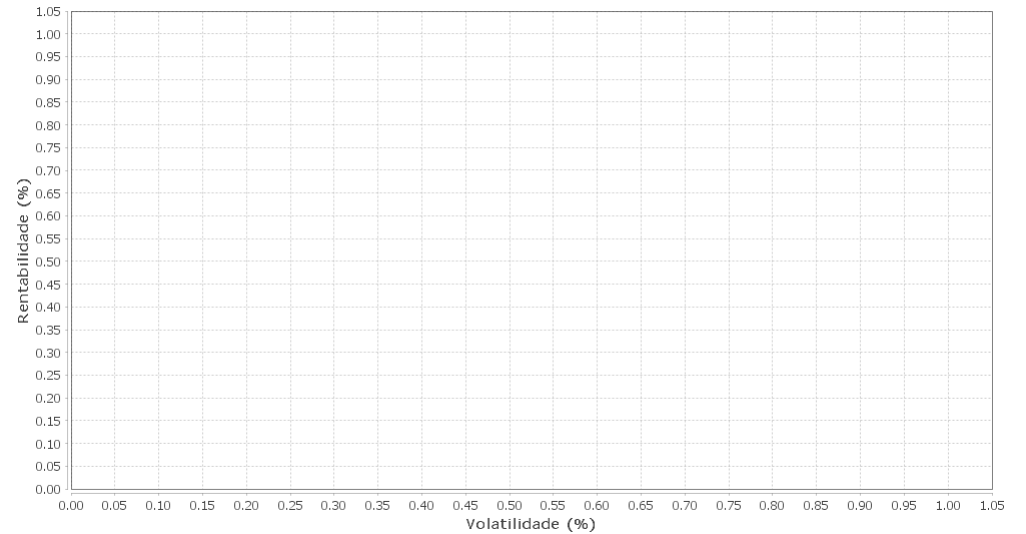
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



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 | 0,01 | 0,02 | 0,49 | 11.630.769,63 | 4,31 |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,02 | 0,02 | 0,49 | 28.313.671,42 | 10,48 |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,04 | 0,03 | 0,49 | 1.095.705,36 | 0,41 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,38 | 0,06 | 0,52 | 25.437.995,92 | 9,42 |
| BB PREVID RF IRF-M1 | Artigo 7º I, Alínea b | 0,38 | 0,06 | 0,52 | 12.423.167,36 | 4,60 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | Artigo 7º I, Alínea b | 0,62 | 0,07 | 0,23 | 813.486,34 | 0,30 |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,19 | 0,16 | 0,81 | 18.831.445,12 | 6,97 |
| Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,31 | 0,16 | 0,47 | 14.298.132,88 | 5,29 |
| BB PREV RF IDKA2 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,50 | 0,16 | 0,05 | 5.754.932,03 | 2,13 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,56 | 0,17 | 0,10 | 8.538.937,58 | 3,16 |
| BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,98 | 0,23 | 0,62 | 6.462.821,52 | 2,39 |
| BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,15 | 0,22 | 0,03 | 5.882.659,89 | 2,18 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b | 2,19 | 0,23 | 0,03 | 8.734.582,33 | 3,23 |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,27 | 0,24 | 0,09 | 3.816.323,77 | 1,41 |
| BB PREV ALOC FIC | Artigo 7º I, Alínea b | 2,48 | 0,26 | 0,08 | 10.989.433,43 | 4,07 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 3,28 | 0,34 | 0,05 | 2.039.937,13 | 0,76 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 3,67 | 0,37 | -0,13 | 1.173.176,29 | 0,43 |
| BB PREV IMAB TPB | Artigo 7º I, Alínea b | 5,18 | 0,52 | -0,42 | 15.834.413,87 | 5,86 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b | 5,23 | 0,52 | -0,42 | 29.313.367,45 | 10,85 |
| Banestes Institucional FI Renda Fixa | Artigo 7º III, Alínea a | 6,80 | 0,62 | -1,92 | 15.358.552,76 | 5,69 |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | Artigo 8º III | 7,18 | 0,76 | 0,29 | 945.069,17 | 0,35 |
| BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B | Artigo 7º I, Alínea b | 7,38 | 0,67 | -2,12 | 32.474.287,32 | 12,02 |
| NTN-B 150535 (4,410000%) | Artigo 7º I, Alínea a | 14,12 | 1,68 | 4,80 | 963.336,81 | 0,36 |
| FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 22,28 | 2,34 | 0,72 | 1.639.607,71 | 0,61 |
| Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | Artigo 8º II, Alínea a | 23,85 | 2,56 | 1,92 | 4.305.885,50 | 1,59 |
| FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 24,22 | 2,59 | 1,86 | 3.025.409,77 | 1,12 |