



**LDB**  
EMPRESAS

**LINHARES**  
JUNHO 2022



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 30.06.2022.

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 85,76%

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 150822 (6,750000%) | 2,98                | 1,07            | 8,02            | 2.095.774,89         | 0,61         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150523 (5,850000%) | 2,94                | 1,00            | 8,57            | 2.646.317,37         | 0,77         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150523 (6,050000%) | 2,94                | 1,02            | 7,86            | 3.139.966,44         | 0,91         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150535 (3,200000%) | 0,53                | 0,79            | 7,22            | 1.115.823,07         | 0,32         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150535 (4,410000%) | 0,53                | 0,88            | 7,84            | 1.105.303,09         | 0,32         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150535 (5,640000%) | 2,85                | 0,98            | 2,64            | 2.443.531,66         | 0,71         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150824 (5,800000%) | 4,14                | 1,00            | 6,13            | 1.464.256,85         | 0,42         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150828 (5,200000%) | 2,84                | 0,95            | 8,24            | 4.258.383,18         | 1,23         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150828 (5,270000%) | 2,85                | 0,95            | 8,28            | 2.094.491,72         | 0,61         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150828 (5,500000%) | 2,88                | 0,97            | 8,39            | 5.420.193,54         | 1,57         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150830 (4,800000%) | 2,74                | 0,92            | 8,04            | 5.481.983,42         | 1,59         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150832 (5,350000%) | 3,96                | 0,96            | 4,34            | 1.875.827,44         | 0,54         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150840 (5,800000%) | 4,06                | 0,31            | 0,31            | 15.647.533,63        | 4,54         |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b> |                          | <b>0,53</b>         | <b>0,97</b>     | <b>8,32</b>     | <b>48.789.386,30</b> | <b>14,15</b> |

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                 | Admin.      | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|-------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| CAIXA DTVM                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 0,19                | 1,02            | 5,52            | 1.256.937,12          | 0,36         | 17.877.663.669,31 | 0,01    |
| BANESTES                               | BANESTES    | BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B                 | 6,47                | -0,33           | 3,59            | 21.011.149,39         | 6,09         | 168.259.357,36    | 12,49   |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,74                | 0,92            | 4,85            | 3.082.603,07          | 0,89         | 5.103.254.867,87  | 0,06    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | 5,42                | -0,35           | 4,22            | 18.292.592,55         | 5,30         | 5.700.982.768,47  | 0,32    |
| CAIXA DTVM                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 5,42                | -0,38           | 4,25            | 18.611.138,88         | 5,40         | 4.111.516.095,57  | 0,45    |
| CAIXA DTVM                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,74                | 0,91            | 4,86            | 385.331,88            | 0,11         | 5.096.804.349,76  | 0,01    |
| CAIXA DTVM                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 2,58                | 0,33            | 6,51            | 22.398.235,70         | 6,49         | 11.084.704.335,99 | 0,20    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF IDKA2                                    | 2,59                | 0,27            | 6,46            | 15.877.121,03         | 4,60         | 9.717.321.383,29  | 0,16    |
| CAIXA DTVM                             | CEF         | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,67                | 0,22            | 6,41            | 29.082.138,20         | 8,43         | 11.226.926.091,22 | 0,26    |
| WESTERN                                | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                    | 3,42                | -0,17           | 4,87            | 0,00                  | 0,00         | 540.277.136,03    | 0,00    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                        | 2,61                | 0,32            | 6,47            | 11.791.815,84         | 3,42         | 6.996.220.208,06  | 0,17    |
| BANESTES                               | BANESTES    | BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                   | 0,54                | 0,94            | 5,03            | 1.041.808,53          | 0,30         | 305.810.254,75    | 0,34    |
| BB                                     | BB          | BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI                   | 2,02                | 0,27            | 6,72            | 3.215.748,50          | 0,93         | 450.401.274,36    | 0,71    |
| BB                                     | BB          | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 2,59                | 0,39            | 3,78            | 0,00                  | 0,00         | 5.102.683.195,98  | 0,00    |
| CAIXA DTVM                             | CEF         | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 2,19                | -0,32           | 4,02            | 0,00                  | 0,00         | 6.957.180.815,09  | 0,00    |
| BANCO DO NORDESTE                      | SANTANDER   | BNB IMA-B FI RF                                     | 4,85                | -0,35           | 4,37            | 1.088.672,75          | 0,32         | 220.169.097,27    | 0,49    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |             |   | <b>3,47</b>         | <b>0,03</b>     | <b>5,09</b>     | <b>147.135.293,44</b> | <b>42,66</b> |                   |         |

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

| Gestor     | Admin.   | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)   | % Carteira | PL do Fundo       | % Fundo |
|------------|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------|-------------------|---------|
| CAIXA DTVM | CEF      | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 0,20                | 1,06            | 5,60            | 11.401.008,43 | 3,31       | 12.613.402.228,26 | 0,09    |
| BANESTES   | BANESTES | BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                   | 5,85                | -0,31           | 4,21            | 15.957.309,60 | 4,63       | 217.590.951,40    | 7,33    |
| BB         | BB       | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 0,18                | 1,03            | 5,54            | 27.203.888,19 | 7,89       | 9.838.414.136,64  | 0,28    |
| BANESTES   | BANESTES | BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI        | 0,22                | 1,04            | 5,70            | 8.727.690,83  | 2,53       | 3.350.165.548,27  | 0,26    |
| BANESTES   | BANESTES | BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI   | 0,22                | 0,98            | 5,36            | 15.472.899,92 | 4,49       | 276.674.791,20    | 5,59    |
| BANESTES   | BANESTES | BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF               | 1,36                | 0,82            | 5,23            | 13.634.122,63 | 3,95       | 161.173.736,95    | 8,46    |
| BB         | BB       | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 2,07                | 0,46            | 4,30            | 6.754.954,44  | 1,96       | 3.751.851.953,61  | 0,18    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                   | Admin.    | Ativo                                  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|--|-----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BANCO DO NORDESTE                        | SANTANDER | BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO | 0,18                | 1,00            | 5,40            | 682.447,50           | 0,20         | 1.030.136.859,07 | 0,07    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |           |  | <b>0,74</b>         | <b>0,74</b>     | <b>5,19</b>     | <b>99.834.321,54</b> | <b>28,95</b> |                  |         |
| Renda Fixa                               |           |  | 2,55                | 0,41            | 5,47            | 295.759.001,28       | 85,76        |                  |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

9,43%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor                       | Admin.   | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|------------------------------|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| CAIXA DTVM                   | CEF      | FIA CAIXA DIVIDENDOS                                   | 18,21               | -8,31           | 4,05            | 1.722.284,81         | 0,50        | 228.591.211,08   | 0,75    |
| AZ QUEST                     | BEM      | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                     | 17,34               | -11,16          | -11,97          | 675.256,54           | 0,20        | 1.032.154.255,89 | 0,07    |
| SOMMA                        | BEM      | SOMMA BRASIL FIA                                       | 20,11               | -13,54          | -9,00           | 1.813.481,69         | 0,53        | 306.366.973,83   | 0,59    |
| CAIXA DTVM                   | CEF      | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS       | 18,28               | -9,04           | 1,33            | 16.136.883,49        | 4,68        | 887.536.834,72   | 1,82    |
| BANESTES                     | BANESTES | BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 24,78               | -10,66          | -13,14          | 5.090.624,51         | 1,48        | 134.409.988,55   | 3,79    |
| BANESTES                     | BANESTES | BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA                            | 18,59               | -9,07           | -1,74           | 1.584.313,30         | 0,46        | 12.118.241,71    | 13,07   |
| BB                           | BB       | BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI                           | 19,21               | -12,76          | -7,24           | 3.580.376,49         | 1,04        | 1.302.667.207,42 | 0,27    |
| TARPON                       | DAYCOVAL | TARPON GT 30 FIC FIA                                   | 18,48               | -3,89           | -3,89           | 1.922.133,21         | 0,56        | 432.625.672,05   | 0,44    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I</b> |          |  | <b>17,45</b>        | <b>-10,12</b>   | <b>-3,31</b>    | <b>32.525.354,04</b> | <b>9,43</b> |                  |         |
| <b>Renda Variável</b>        |          |  | <b>17,69</b>        | <b>-10,12</b>   | <b>-3,31</b>    | <b>32.525.354,04</b> | <b>9,43</b> |                  |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,10%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor                        | Admin.      | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| PLURAL                        | BNP PARIBAS | GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE                                | 19,45               | 2,38            | -23,87          | 2.148.614,42        | 0,62        | 122.220.821,15 | 1,76    |
| PLURAL                        | BNP PARIBAS | GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE                                    | 50,11               | -0,05           | -60,02          | 957.011,12          | 0,28        | 179.511.776,28 | 0,53    |
| XP                            | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 31,97               | -2,83           | -47,08          | 504.946,73          | 0,15        | 568.267.517,75 | 0,09    |
| SCHRODER                      | BEM         | SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE             | 19,84               | 0,33            | -27,32          | 3.648.505,29        | 1,06        | 269.329.951,07 | 1,35    |
| <b>Sub-total Artigo 9º II</b> |             |   | <b>22,19</b>        | <b>0,65</b>     | <b>-35,13</b>   | <b>7.259.077,56</b> | <b>2,10</b> |                |         |
| Investimentos no Exterior     |             |   | 22,19               | 0,65            | -35,13          | 7.259.077,56        | 2,10        |                |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,71%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor                            | Admin. | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira    | PL do Fundo    | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|---------------|----------------|---------|
| CAIXA DTVM                        | CEF    | FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO | 6,89                | 1,88            | -0,34           | 2.039.184,66          | 0,59          | 113.501.310,87 | 1,80    |
| CAIXA DTVM                        | CEF    | FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO                          | 5,85                | -2,31           | 3,37            | 2.993.232,85          | 0,87          | 930.017.234,94 | 0,32    |
| RIO BRAVO                         | BEM    | RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                               | 5,56                | -1,97           | -4,20           | 4.310.831,17          | 1,25          | 120.868.950,78 | 3,57    |
| <b>Sub-total Artigo 10º I</b>     |        |  | <b>3,59</b>         | <b>-1,27</b>    | <b>-0,30</b>    | <b>9.343.248,68</b>   | <b>2,71</b>   |                |         |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |        |  | <b>3,59</b>         | <b>-1,27</b>    | <b>-0,30</b>    | <b>9.343.248,68</b>   | <b>2,71</b>   |                |         |
| <b>Total</b>                      |        |  | <b>3,40</b>         | <b>-0,66</b>    | <b>3,08</b>     | <b>344.886.681,56</b> | <b>100,00</b> |                |         |



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo                            | Tipo de Ativo                           | Valor(R\$)            | % Carteira    | Política de Investimentos |          |        |      |              |
|-----------------------------------|---|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
|                                   |   |                       |               | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | ALM  | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>                 |   |                       |               |                           |          |        |      |              |
| Artigo 7º I, Alínea a             | Títulos do Tesouro Nacional             | 48.789.386,30         | 14,15         | 0,00                      | 34,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º I, Alínea b             | Fundos 100% Títulos Públicos            | 147.135.293,44        | 42,66         | 0,00                      | 15,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a           | Fundos Renda Fixa                       | 99.834.321,54         | 28,95         | 0,00                      | 28,00    | 60,00  | 0,00 | 60,00        |
|                                   | <b>Total Renda Fixa</b>                 | <b>295.759.001,28</b> | <b>85,76</b>  |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Renda Variável</b>             |   |                       |               |                           |          |        |      |              |
| Artigo 8º I                       | Fundos de Ações                         | 32.525.354,04         | 9,43          | 0,00                      | 11,00    | 30,00  | 0,00 | 30,00        |
|                                   | <b>Total Renda Variável</b>             | <b>32.525.354,04</b>  | <b>9,43</b>   |                           |          |        |      | 30,00        |
| <b>Investimentos no Exterior</b>  |   |                       |               |                           |          |        |      |              |
| Artigo 9º II                      | Fundos de Investimento no Exterior      | 7.259.077,56          | 2,10          | 0,00                      | 4,00     | 10,00  | 0,00 | 10,00        |
|                                   | <b>Total Investimentos no Exterior</b>  | <b>7.259.077,56</b>   | <b>2,10</b>   |                           |          |        |      | 10,00        |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |   |                       |               |                           |          |        |      |              |
| Artigo 10º I                      | Fundos Multimercados                    | 9.343.248,68          | 2,71          | 0,00                      | 5,00     | 10,00  | 0,00 | 10,00        |
|                                   | <b>Total Investimentos Estruturados</b> | <b>9.343.248,68</b>   | <b>2,71</b>   |                           |          |        |      | 15,00        |
| <b>Total</b>                      |   | <b>344.886.681,56</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      |              |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

| Estratégia Indexador                | No Mês           | No Ano            | 3 meses           | 6 meses           | 12 meses          | No Mês(R\$)          | No Ano(R\$)          |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a<br>% do CDI   | 0,97<br>95,27    | 8,32<br>153,96    | 4,19<br>144,20    | 8,32<br>153,96    | 17,19<br>198,58   | 364.008,33           | 2.355.859,99         |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI   | 0,03<br>3,40     | 5,09<br>94,27     | 1,98<br>68,14     | 5,09<br>94,27     | 5,92<br>68,38     | 117.831,90           | 8.017.709,14         |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 0,74<br>73,17    | 5,19<br>96,11     | 2,58<br>88,67     | 5,19<br>96,11     | 5,19<br>59,98     | 734.897,59           | 4.926.886,50         |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -10,12<br>1,38   | -3,31<br>2,68     | -14,81<br>3,07    | -3,31<br>2,68     |                   | -3.397.491,40        | -1.119.236,51        |
| Artigo 9º II<br>% do CDI            | 0,65<br>63,93    | -35,13<br>-650,37 | -13,12<br>-451,28 | -35,13<br>-650,37 | -28,53<br>-329,66 | 46.735,49            | -3.931.058,08        |
| Artigo 10º I<br>% do CDI            | -1,27<br>-124,98 | -0,30<br>-5,50    | -2,46<br>-84,59   | -0,30<br>-5,50    |                   | -119.872,31          | -98.667,66           |
| <b>LINHARES (Total)</b>             |                  |                   |                   |                   |                   | <b>-2.253.890,40</b> | <b>10.151.493,38</b> |

**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 150523 (5,850000%) | 2.620.118,27   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.646.317,37 | 26.199,10                   | 213.866,66                  |
| NTN-B 150523 (6,050000%) | 3.108.391,29   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.139.966,44 | 31.575,15                   | 234.099,89                  |
| NTN-B 150535 (3,200000%) | 1.107.114,12   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.115.823,07 | 8.708,95                    | 76.589,91                   |
| NTN-B 150535 (4,410000%) | 1.095.611,29   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.105.303,09 | 9.691,80                    | 82.039,79                   |
| NTN-B 150535 (5,640000%) | 2.419.742,91   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.443.531,66 | 23.788,75                   | 63.711,29                   |
| NTN-B 150822 (6,750000%) | 2.073.563,44   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.095.774,89 | 22.211,45                   | 156.055,38                  |
| NTN-B 150824 (5,800000%) | 1.449.818,68   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.464.256,85 | 14.438,17                   | 84.516,36                   |
| NTN-B 150828 (5,200000%) | 4.218.390,03   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.258.383,18 | 39.993,15                   | 326.020,91                  |
| NTN-B 150828 (5,270000%) | 2.074.706,45   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.094.491,72 | 19.785,27                   | 160.993,86                  |
| NTN-B 150828 (5,500000%) | 5.368.018,26   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.420.193,54 | 52.175,28                   | 422.065,59                  |
| NTN-B 150830 (4,800000%) | 5.432.225,35   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.481.983,42 | 49.758,07                   | 410.048,73                  |
| NTN-B 150832 (5,350000%) | 1.857.989,01   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.875.827,44 | 17.838,43                   | 78.006,85                   |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                    | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|---------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150840 (5,800000%) | 0,00           | 15.599.688,87 | 0,00     | 0,00        | 15.647.533,63 | 47.844,76                   | 47.844,76                   |
|                          |                |               |          |             | 48.789.386,30 | 0,00                        | 0,00                        |

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

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates       | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B                 | 21.080.652,47  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 21.011.149,39  | -69.503,08                  | 597.234,55                  |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                   | 1.032.111,71   | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 1.041.808,53   | 9.696,82                    | 49.882,07                   |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 13.979.494,30  | 0,00       | -14.034.313,79 | 0,00        | 0,00           | 54.819,49                   | 510.869,86                  |
| BB PREV RF IDKA2                                    | 15.834.983,19  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 15.877.121,03  | 42.137,84                   | 962.967,13                  |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | 18.357.345,30  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 18.292.592,55  | -64.752,75                  | 739.866,98                  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                        | 11.754.473,11  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 11.791.815,84  | 37.342,73                   | 706.449,96                  |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 3.054.558,80   | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 3.082.603,07   | 28.044,27                   | 142.665,75                  |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI                   | 3.207.088,05   | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 3.215.748,50   | 8.660,45                    | 203.299,01                  |
| BNB IMA-B FI RF                                     | 1.092.445,08   | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 1.088.672,75   | -3.772,33                   | 45.590,58                   |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 29.017.042,07  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 29.082.138,20  | 65.096,13                   | 1.752.574,25                |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 22.323.768,25  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 22.398.235,70  | 74.467,45                   | 1.345.340,19                |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 18.681.830,88  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 18.611.138,88  | -70.692,00                  | 758.913,40                  |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 381.857,05     | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 385.331,88     | 3.474,83                    | 17.845,80                   |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 1.244.203,43   | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 1.256.937,12   | 12.733,69                   | 65.736,99                   |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 2.760.329,85   | 0,00       | -2.751.579,19  | 0,00        | 0,00           | -8.750,66                   | 106.237,42                  |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                    | 674.540,26     | 0,00       | -673.369,28    | 0,00        | 0,00           | -1.170,98                   | 14.559,21                   |
|   |                |            |                |             | 147.135.293,44 | 0,00                        | 0,00                        |

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

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF             | 13.523.400,39  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 13.634.122,63 | 110.722,24                  | 678.058,22                  |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                 | 16.006.921,91  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 15.957.309,60 | -49.612,31                  | 644.503,12                  |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI      | 8.638.139,78   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 8.727.690,83  | 89.551,05                   | 470.844,75                  |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI | 15.322.410,58  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 15.472.899,92 | 150.489,34                  | 787.176,56                  |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 6.723.848,19   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 6.754.954,44  | 31.106,25                   | 278.430,82                  |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 26.927.634,50  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 27.203.888,19 | 276.253,69                  | 1.428.686,95                |
| BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO         | 675.711,48     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 682.447,50    | 6.736,02                    | 34.939,30                   |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 11.281.357,12  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 11.401.008,43 | 119.651,31                  | 604.246,78                  |
|  |                |            |          |             | 99.834.321,54 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|--------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                     | 760.071,18     | 0,00         | 0,00     | 0,00        | 675.256,54    | -84.814,64                  | -91.810,09                  |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA                            | 1.742.254,62   | 0,00         | 0,00     | 0,00        | 1.584.313,30  | -157.941,32                 | -27.975,71                  |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 5.697.858,37   | 0,00         | 0,00     | 0,00        | 5.090.624,51  | -607.233,86                 | -769.774,24                 |
| BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI                           | 4.104.268,94   | 0,00         | 0,00     | 0,00        | 3.580.376,49  | -523.892,45                 | -293.608,57                 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS                                   | 1.878.369,01   | 0,00         | 0,00     | 0,00        | 1.722.284,81  | -156.084,20                 | 67.017,33                   |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS       | 17.740.152,05  | 0,00         | 0,00     | 0,00        | 16.136.883,49 | -1.603.268,56               | 211.299,87                  |
| SOMMA BRASIL FIA                                       | 999.871,27     | 1.000.000,00 | 0,00     | 0,00        | 1.813.481,69  | -186.389,58                 | -136.518,31                 |
| TARPON GT 30 FIC FIA                                   | 0,00           | 2.000.000,00 | 0,00     | 0,00        | 1.922.133,21  | -77.866,79                  | -77.866,79                  |
|  |                |              |          |             | 32.525.354,04 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE                                | 2.098.713,29   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.148.614,42 | 49.901,13                   | -673.578,09                 |
| GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE                                    | 957.467,34     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 957.011,12   | -456,22                     | -1.436.827,17               |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 519.635,47     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 504.946,73   | -14.688,74                  | -449.160,32                 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE             | 3.636.525,97   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.648.505,29 | 11.979,32                   | -1.371.492,50               |
|   |                |            |          |             | 7.259.077,56 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO                          | 3.064.072,03   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.993.232,85 | -70.839,18                  | 97.520,63                   |
| FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO | 2.001.635,72   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.039.184,66 | 37.548,94                   | -7.019,46                   |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                               | 4.397.413,24   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.310.831,17 | -86.582,07                  | -189.168,83                 |
|  |                |            |          |             | 9.343.248,68 | 0,00                        | 0,00                        |

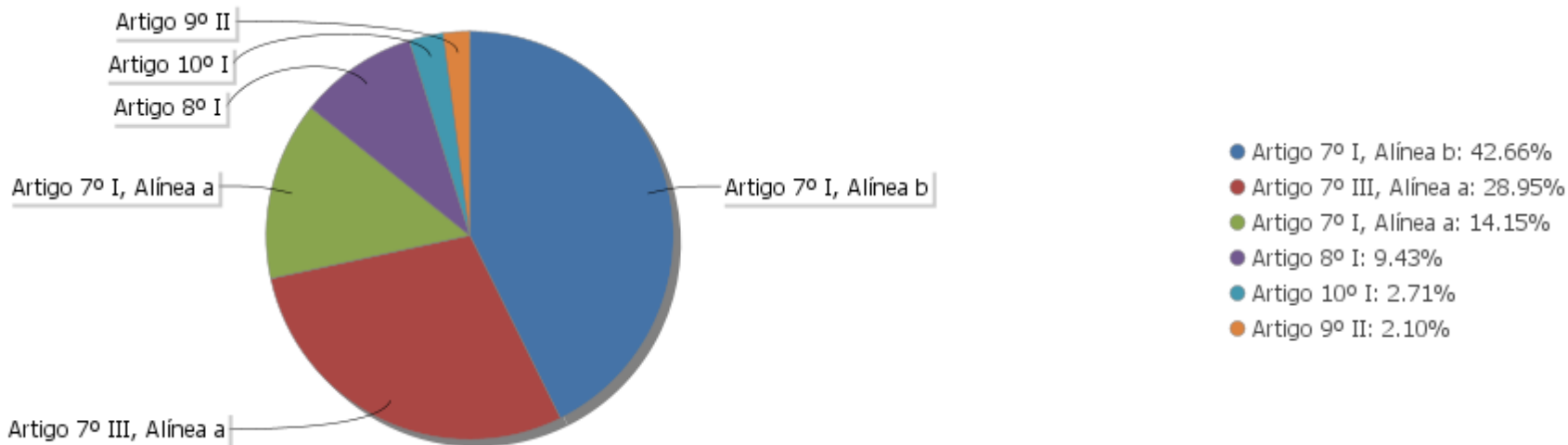
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

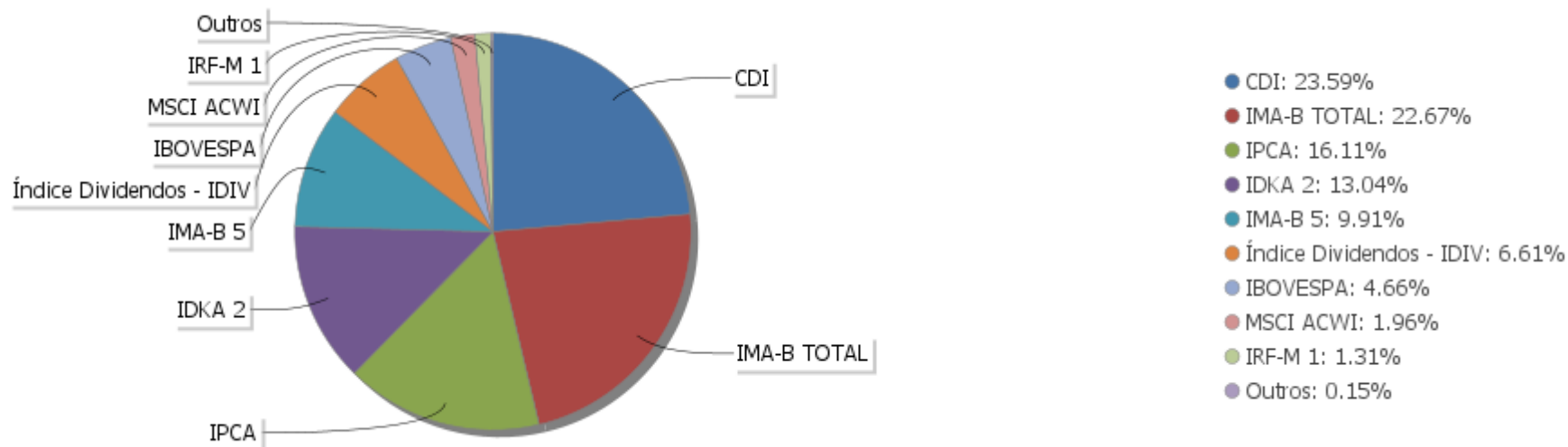
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 271.827.680,44 | 78,82 | 271.827.680,44        | 78,82     |
| de 31 a 365 dias  | 28.935.925,02  | 8,39  | 300.763.605,46        | 87,21     |
| acima de 365 dias | 44.123.076,10  | 12,79 | 344.886.681,56        | 100,00    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

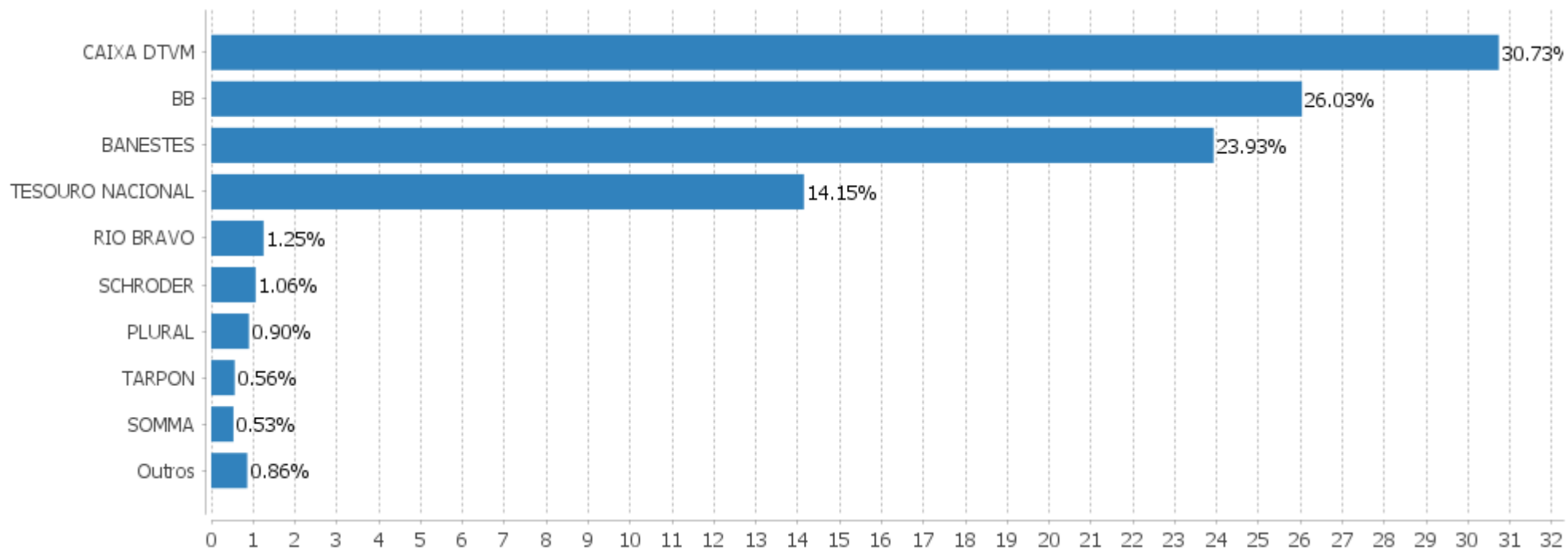


Alocação Por Estratégia



## 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 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2022           | 0,23  | 0,39  | 2,25  | -0,02 | 0,88  | -0,66 |       |       |       |       |       |       | 3,08      |
| INPC + 4,93%   | 1,07  | 1,37  | 2,14  | 1,41  | 0,87  | 1,02  |       |       |       |       |       |       | 8,14      |
| p.p. indexador | -0,85 | -0,97 | 0,11  | -1,43 | 0,00  | -1,68 |       |       |       |       |       |       | -5,06     |
| 2021           | -0,93 | -1,16 | 0,23  | 0,72  | 1,07  | 0,17  | -0,44 | -0,62 | -0,56 | -1,41 | 1,62  | 0,55  | -0,80     |
| INPC + 5,45%   | 0,69  | 1,20  | 1,35  | 0,80  | 1,41  | 1,05  | 1,49  | 1,35  | 1,65  | 1,59  | 1,27  | 1,22  | 16,14     |
| p.p. indexador | -1,63 | -2,36 | -1,12 | -0,08 | -0,34 | -0,87 | -1,93 | -1,97 | -2,21 | -3,00 | 0,35  | -0,67 | -16,94    |
| 2020           | 0,49  | -0,30 | -6,00 | 1,19  | 1,40  | 1,41  | 2,77  | -1,09 | -1,53 | 0,16  | 1,96  | 3,27  | 3,46      |
| 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 | -0,21 | -0,89 | -6,69 | 0,96  | 1,19  | 0,63  | 1,79  | -1,94 | -2,89 | -1,22 | 0,55  | 1,29  | -8,29     |
| 2019           | 2,03  | 0,57  | 0,45  | 0,98  | 2,17  | 2,28  | 1,23  | -0,12 | 1,94  | 2,06  | -1,14 | 1,47  | 14,79     |
| 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 | 1,15  | -0,43 | -0,77 | -0,11 | 1,51  | 1,83  | 0,60  | -0,75 | 1,50  | 1,49  | -2,14 | -0,25 | 4,02      |
| 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 + 6,00%   | 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 | 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

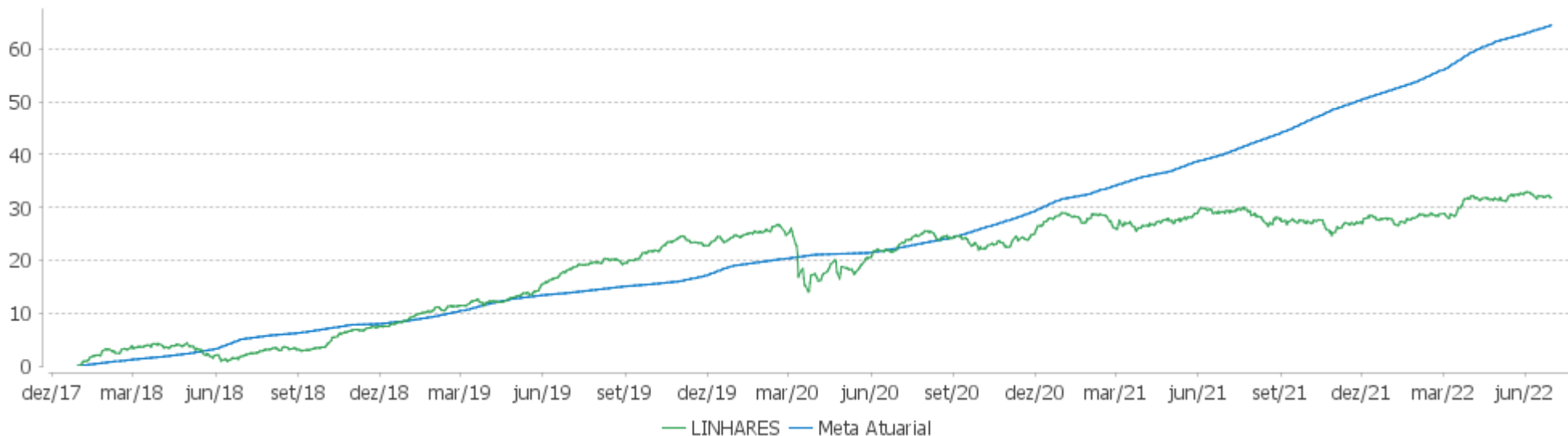
|                              | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 20         | 37,04     | 03 meses         | 0,19     | 3,34          | -3,15      | 2,68               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 34         | 62,96     | 06 meses         | 3,08     | 8,14          | -5,06      | 2,94               |
|                              |            |           | 12 meses         | 2,17     | 17,73         | -15,57     | 3,40               |
|                              |            |           | 24 meses         | 7,95     | 35,93         | -27,98     | 3,44               |
|                              |            |           | 36 meses         | 11,64    | 47,50         | -35,86     | 4,60               |
|                              |            |           | 48 meses         | 29,52    | 61,42         | -31,90     | 4,11               |
|                              |            |           | Desde 29/12/2017 | 31,84    | 70,39         | -38,55     | 4,02               |

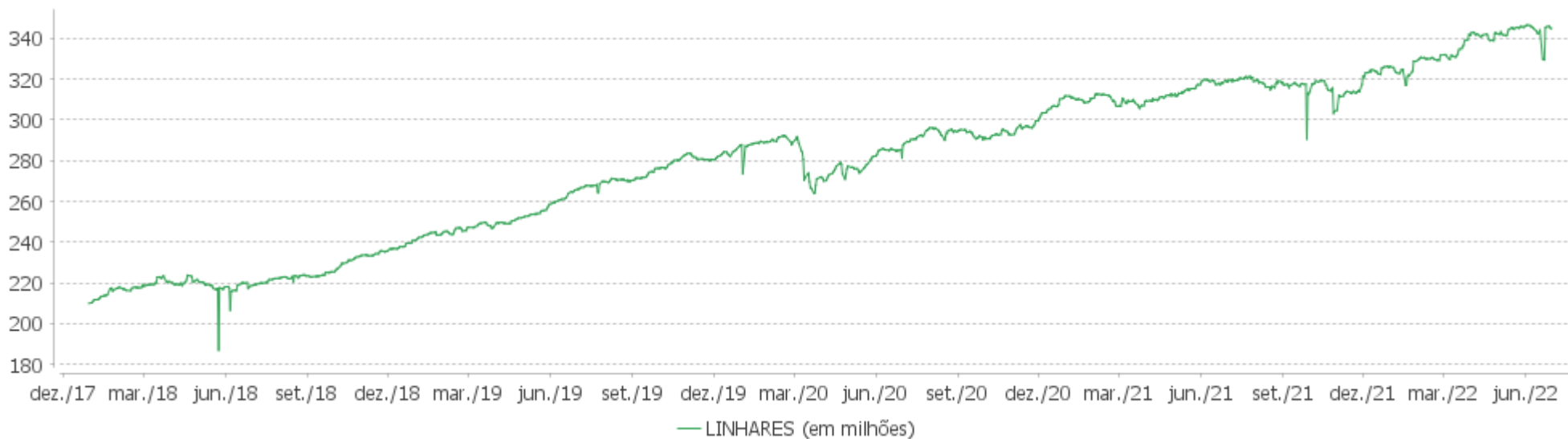
|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,27          | 2020-12 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,00         | 2020-03 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

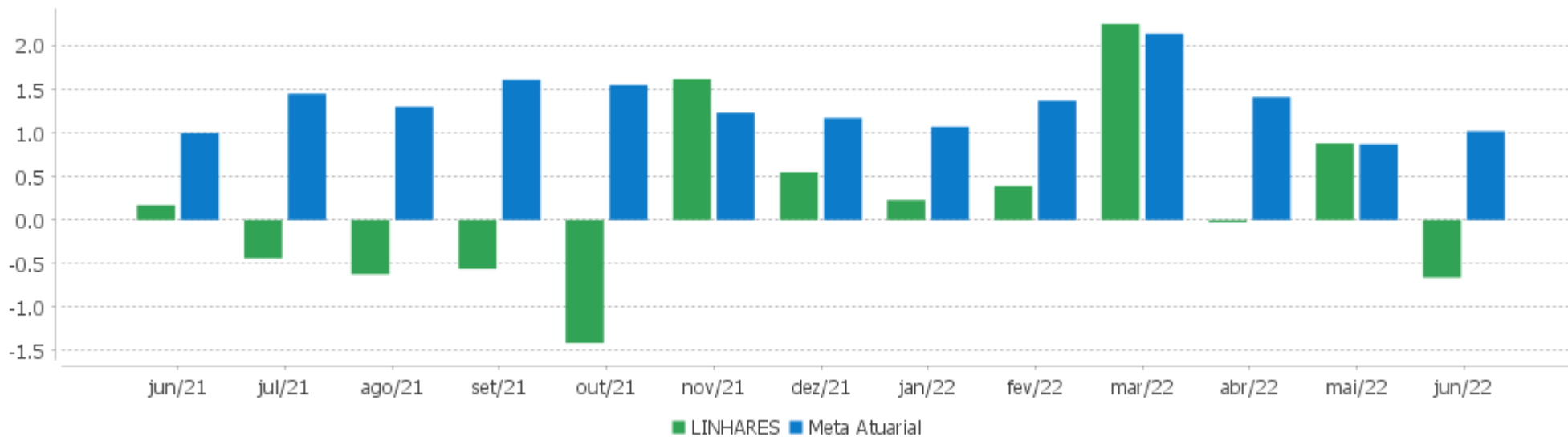


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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       |
|---|----------------|---------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|
| NTN-B 150535 (4,410000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,88<br>0,21   | 7,84<br>2,35  | 3,95<br>1,74  | 7,84<br>2,35  | 16,73<br>4,84  | 19,34<br>-1,89 | 40,50<br>16,69 |
| NTN-B 150523 (6,050000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 1,02<br>0,35   | 8,67<br>3,18  | 4,35<br>2,14  | 8,67<br>3,18  | 15,15<br>3,27  | 24,65<br>3,43  | 27,27<br>3,46  |
| NTN-B 150830 (4,800000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,92<br>0,25   | 8,04<br>2,55  | 4,05<br>1,83  | 8,04<br>2,55  | 14,06<br>2,17  | 22,61<br>1,38  | 24,35<br>0,53  |
| NTN-B 150535 (5,640000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,98<br>0,31   | 8,46<br>2,98  | 4,25<br>2,04  | 8,46<br>2,98  | 14,82<br>2,93  | 24,06<br>2,83  | 26,44<br>2,63  |
| NTN-B 150828 (5,270000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,95<br>0,28   | 8,28<br>2,79  | 4,16<br>1,95  | 8,28<br>2,79  | 14,44<br>2,55  | 23,28<br>2,06  | 25,29<br>1,48  |
| NTN-B 150828 (5,500000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,97<br>0,30   | 8,39<br>2,91  | 4,22<br>2,00  | 8,39<br>2,91  | 14,65<br>2,76  | 23,68<br>2,46  | 25,87<br>2,06  |
| NTN-B 150523 (5,850000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 1,00<br>0,33   | 8,57<br>3,08  | 4,30<br>2,09  | 8,57<br>3,08  | 14,95<br>3,06  | 24,22<br>3,00  | 26,63<br>2,82  |
| NTN-B 150822 (6,750000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 1,07<br>0,40   | 9,02<br>3,54  | 4,52<br>2,30  | 9,02<br>3,54  | 15,89<br>4,01  | 26,19<br>4,97  | 29,57<br>5,76  |
| NTN-B 150828 (5,200000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,95<br>0,28   | 8,24<br>2,75  | 4,14<br>1,93  | 8,24<br>2,75  | 14,38<br>2,49  | 23,16<br>1,94  | 25,11<br>1,30  |
| NTN-B 150824 (5,800000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 1,00<br>0,33   | 5,44<br>-0,04 | 4,29<br>2,07  | 5,44<br>-0,04 | 11,62<br>-0,27 | 20,59<br>-0,63 | 22,90<br>-0,91 |
| NTN-B 150832 (5,350000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,96<br>0,29   | 5,36<br>-0,13 | 4,18<br>1,97  | 5,36<br>-0,13 | 11,43<br>-0,46 | 20,20<br>-1,03 | 22,30<br>-1,51 |
| NTN-B 150535 (3,200000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 0,79<br>0,12   | 7,22<br>1,74  | 3,65<br>1,44  | 7,22<br>1,74  | 15,37<br>3,49  | 27,53<br>6,30  | 32,74<br>8,93  |
| NTN-B 150840 (5,800000%)<br>Var. IPCA p.p.                            | 1,00<br>0,33   | 5,50<br>0,01  | 4,29<br>2,07  | 5,50<br>0,01  | 11,74<br>-0,15 | 20,84<br>-0,39 | 23,26<br>-0,55 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,38<br>-0,01 | 4,25<br>-0,10 | 1,39<br>-0,04 | 4,25<br>-0,10 | 3,52<br>-0,26  | 10,96<br>-0,52 | 15,98<br>-1,02 |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B 5 p.p.                 | 0,23<br>-0,11  | 5,29<br>-1,32 | 2,11<br>-0,59 | 5,29<br>-1,32 | 6,59<br>-3,47  | 10,69<br>-6,05 | 22,95<br>-4,08 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.   | 0,33<br>-0,00  | 6,51<br>-0,10 | 2,65<br>-0,04 | 6,51<br>-0,10 | 9,84<br>-0,22  | 16,18<br>-0,56 | 26,06<br>-0,96 |
| BNB IMA-B FI RF   | -0,35          | 4,37          | 1,43          | 4,37          | 4,05           | 10,59          | 15,79          |

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           | 0,02           | -0,00          | 0,02           | 0,27           | -0,90           | -1,21           |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.          | 0,92<br>-0,01  | 4,85<br>-0,14  | 2,56<br>-0,09  | 4,85<br>-0,14  | 6,92<br>-0,27  | 8,69<br>-0,68   | 14,89<br>-1,05  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.                       | 0,32<br>-0,02  | 6,47<br>-0,14  | 2,63<br>-0,06  | 6,47<br>-0,14  | 9,74<br>-0,33  | 16,08<br>-0,66  | 26,05<br>-0,98  |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>% do CDI                      | 1,02<br>100,98 | 5,52<br>102,17 | 2,87<br>98,77  | 5,52<br>102,17 | 8,84<br>102,09 | 10,78<br>96,90  | 15,92<br>97,94  |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.              | 0,27<br>0,63   | 6,72<br>2,37   | 2,73<br>1,30   | 6,72<br>2,37   | 10,57<br>6,79  | 16,93<br>5,44   | 26,76<br>9,76   |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.            | -0,33<br>0,03  | 3,59<br>-0,76  | 1,23<br>-0,20  | 3,59<br>-0,76  | 0,03<br>-3,75  | 4,98<br>-6,51   | 4,20<br>-12,80  |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1<br>Var. IRF-M 1 p.p.                  | 0,94<br>0,01   | 5,03<br>0,04   | 2,70<br>0,05   | 5,03<br>0,04   | 7,36<br>0,17   | 8,38<br>-0,99   | 18,32<br>2,37   |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.                                    | 0,27<br>-0,21  | 6,46<br>-0,39  | 2,54<br>-0,31  | 6,46<br>-0,39  | 9,84<br>-0,26  | 16,85<br>-1,03  | 26,41<br>-1,81  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.      | 0,33           | 3,71           | 1,67           | 3,71           | 4,01           | 6,69            | 13,42           |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.          | 0,23<br>-0,44  | 4,59<br>-0,90  | 2,22<br>0,01   | 4,59<br>-0,90  | 3,73<br>-8,16  | 6,51<br>-14,72  | 16,97<br>-6,84  |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p. | 0,22<br>-0,25  | 6,41<br>-0,43  | 2,50<br>-0,36  | 6,41<br>-0,43  | 9,66<br>-0,45  | 16,68<br>-1,21  | 26,24<br>-1,99  |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | -0,35<br>0,01  | 4,22<br>-0,13  | 1,41<br>-0,02  | 4,22<br>-0,13  | 3,48<br>-0,29  | 10,88<br>-0,60  | 16,14<br>-0,86  |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.        | 0,91<br>-0,02  | 4,86<br>-0,13  | 2,58<br>-0,07  | 4,86<br>-0,13  | 6,94<br>-0,24  | 8,89<br>-0,48   | 15,19<br>-0,76  |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                   | -0,31<br>0,05  | 4,21<br>-0,14  | 1,40<br>-0,03  | 4,21<br>-0,14  | 2,41<br>-1,37  | 6,26<br>-5,23   | 4,47<br>-12,52  |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI<br>% do CDI                | 0,98<br>96,90  | 5,36<br>99,23  | 2,85<br>98,12  | 5,36<br>99,23  | 8,76<br>101,24 | 12,28<br>110,41 | 13,41<br>82,52  |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI<br>% do CDI                     | 1,04<br>102,28 | 5,70<br>105,57 | 3,02<br>103,85 | 5,70<br>105,57 | 9,48<br>109,49 | 13,50<br>121,41 | 14,72<br>90,56  |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF<br>% do CDI                            | 0,82<br>80,78  | 5,23<br>96,89  | 2,68<br>92,10  | 5,23<br>96,89  | 6,93<br>80,11  | 9,41<br>84,59   | 16,46<br>101,24 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                          | 1,03<br>101,22 | 5,54<br>102,62 | 2,90<br>99,83  | 5,54<br>102,62 | 8,98<br>103,80 | 11,54<br>103,80 | 16,07<br>98,90  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI                          | 0,46           | 4,30           | 2,02           | 4,30           | 5,27           | 8,66            |                 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia  | No Mês           | No Ano           | 3 meses          | 6 meses          | 12 meses         | 24 meses         | 36 meses         |
|--|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| Var. IPCA p.p.   | -0,21            | -1,19            | -0,20            | -1,19            | -6,62            | -12,57           |                  |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                                    | 1,06<br>104,64   | 5,60<br>103,61   | 2,97<br>102,04   | 5,60<br>103,61   | 9,19<br>106,13   | 11,59<br>104,22  | 16,08<br>98,96   |
| BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO<br>% do CDI   | 1,00<br>98,36    | 5,40<br>99,90    | 2,81<br>96,81    | 5,40<br>99,90    | 8,73<br>100,92   | 10,66<br>95,82   | 15,35<br>94,43   |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -10,66<br>-2,27  | -13,14<br>-17,72 | -20,86<br>-11,43 | -13,14<br>-17,72 | -43,16<br>-39,06 | -30,19<br>-48,90 | -24,08<br>-42,61 |
| TARPON GT 30 FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -10,38<br>1,12   | -3,54<br>2,45    | -16,04<br>1,84   | -3,54<br>2,45    | -10,61<br>11,68  | 42,09<br>38,42   |                  |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -8,31<br>3,19    | 4,05<br>10,04    | -9,45<br>8,44    | 4,05<br>10,04    | -7,36<br>14,93   | 11,21<br>7,54    | 9,52<br>11,92    |
| BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -12,76<br>-1,26  | -7,24<br>-1,25   | -16,81<br>1,07   | -7,24<br>-1,25   | -17,83<br>4,46   | 14,76<br>11,10   | 18,19<br>20,59   |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                     | -11,16<br>0,34   | -11,97<br>-5,98  | -17,17<br>0,72   | -11,97<br>-5,98  | -29,80<br>-7,51  | -3,42<br>-7,09   | 3,57<br>5,97     |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.       | -9,04<br>-0,65   | 1,33<br>-3,26    | -12,41<br>-2,98  | 1,33<br>-3,26    | -12,62<br>-8,52  | 12,31<br>-6,41   | 9,68<br>-8,85    |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.                            | -9,07<br>-0,68   | -1,74<br>-6,32   | -12,39<br>-2,96  | -1,74<br>-6,32   | -22,32<br>-18,23 |                  |                  |
| SOMMA BRASIL FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -13,54<br>-2,03  | -9,01<br>-3,02   | -17,88<br>0,00   | -9,01<br>-3,02   | -26,33<br>-4,04  | -5,84<br>-9,51   | -11,58<br>-9,17  |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE<br>Var. MSCI ACWI p.p.                                    | 2,38<br>1,12     | -23,87<br>1,92   | -2,64<br>4,64    | -23,87<br>1,92   | -6,54<br>6,66    |                  |                  |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE<br>Var. MSCI ACWI p.p.                 | 0,33<br>-0,93    | -27,32<br>-1,53  | -8,82<br>-1,54   | -27,32<br>-1,53  | -14,58<br>-1,38  |                  |                  |
| GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE<br>Var. MSCI ACWI p.p.  | -0,05<br>-1,30   | -60,02<br>-34,23 | -36,07<br>-28,80 | -60,02<br>-34,23 | -60,24<br>-47,04 |                  |                  |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR<br>Var. IPCA + 6,00% p.p.  | -2,83<br>-3,99   | -47,08<br>-55,63 | -22,26<br>-25,95 | -47,08<br>-55,63 | -44,47<br>-63,07 | -28,51<br>-64,68 |                  |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO<br>Var. IBOVESPA p.p.                                     | -1,97<br>9,53    | -4,10<br>5,58    | -4,75<br>13,13   |                  |                  |                  |                  |
| FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO<br>Var. IBOVESPA p.p.       | 1,88<br>13,38    | -0,34<br>5,65    | 3,45<br>21,33    | -0,34<br>5,65    | 2,77<br>25,06    |                  |                  |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO<br>% do CDI  | -2,31<br>-228,10 | 3,37<br>62,35    | -2,87<br>-98,91  | 3,37<br>62,35    | 0,22<br>2,53     | 8,47<br>76,14    | 12,39<br>76,21   |
| LINHARES   | -0,66            | 3,08             | 0,19             | 3,08             | 2,17             | 7,95             | 11,64            |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. INPC + 4,93% p.p.          | -1,68  | -5,06  | -3,15   | -5,06   | -15,27   | -26,61   | -32,90   |
| CDI                             | 1,01   | 5,40   | 2,91    | 5,40    | 8,66     | 11,12    | 16,25    |
| IBOVESPA                        | -11,50 | -5,99  | -17,88  | -5,99   | -22,29   | 3,67     | -2,40    |
| INPC + 6,00%                    | 1,11   | 8,68   | 3,60    | 8,68    | 18,63    | 37,32    | 49,01    |
| IPCA + 6,00%                    | 1,16   | 8,56   | 3,69    | 8,56    | 18,60    | 36,18    | 47,46    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo  | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas       |               |
|--|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
|  | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                     | D+1 du    | D+0        | D+27      | D+29       | -           | 2,00          |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA                            | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+5 du     |             |               |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF                       | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+2 du     |             | 0,50          |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | D+1 du    | D+0        | D+30      | D+34       |             | 0,00          |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                           | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI                | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B                    | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                      | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |             | 0,15          |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI           | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,80          |
| BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI                           | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 2,00          |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                       | D+0       | D+0        | D+3 du    | D+3 du     |             | 0,30          |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI         | D+0       | D+0        |           | D+3 du     |             |               |
| 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 5 LP FIC FI                           | 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          |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                     | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI                      | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BNB IMA-B FI RF  | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |             | 0,20          |
| BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO                 | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |             | 0,50          |
| 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI             | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo   | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas   |               |
|---|-----------|------------|-----------|------------|---|---------------|
|   | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance   | Administração |
| LP  |           |            |           |            |   |               |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP                            | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |   | 0,20          |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO                           | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |   | 1,00          |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS  | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |   | 1,50          |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF                      | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |   | 0,40          |
| FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO  | D+0       | D+0        |           | D+2        |   |               |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS                  | D+1 du    | D+0        | D+30 du   | D+32 du    |   | 1,72          |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE                                | D+1       | D+1        | D+1       | D+5        |   |               |
| GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE                                    | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+6 du     |   |               |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+5 du     |   | 0,80          |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                                | D+0       | D+0        | D+1       | D+2        |   |               |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE             | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+4 du     | -   |               |
| SOMMA BRASIL FIA  | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+3 du     | -   | 2,00          |
| TARPON GT 30 FIC FIA  | D+1 du    | D+1 du     | D+30      | D+32       | O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro |               |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                                  | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |   | 0,40          |

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         | 0,93   | 4,99   | 2,65    | 4,99    | 7,19     | 9,37     | 15,94    | 24,32    | 34,03    |
| IRF-M 1+        | 0,09   | 0,73   | -0,06   | 0,73    | -1,02    | -2,10    | 9,44     | 30,43    | 42,54    |
| IRF-M TOTAL     | 0,37   | 2,19   | 0,83    | 2,19    | 1,76     | 1,90     | 11,90    | 29,50    | 41,08    |
| IMA-B 5         | 0,33   | 6,61   | 2,69    | 6,61    | 10,06    | 16,74    | 27,03    | 45,64    | 59,81    |
| IMA-B 5+        | -1,10  | 2,03   | 0,12    | 2,03    | -2,16    | 6,18     | 8,27     | 52,42    | 61,74    |
| IMA-B TOTAL     | -0,36  | 4,35   | 1,43    | 4,35    | 3,78     | 11,48    | 17,00    | 50,64    | 62,99    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,43   | 4,49   | 1,90    | 4,49    | 5,34     | 9,08     | 16,19    | 34,66    | 46,06    |
| IDKA 2          | 0,47   | 6,85   | 2,86    | 6,85    | 10,11    | 17,88    | 28,22    | 45,20    | 59,68    |
| IDKA 20         | -2,95  | -2,61  | -2,97   | -2,61   | -13,58   | -2,92    | -7,47    | 53,52    | 57,70    |
| CDI             | 1,01   | 5,40   | 2,91    | 5,40    | 8,66     | 11,12    | 16,25    | 23,60    | 32,71    |

Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -11,50 | -5,99  | -17,88  | -5,99   | -22,29   | 3,67     | -2,40    | 35,43    | 56,67    |
| IBRX 100                 | -11,56 | -5,72  | -17,94  | -5,72   | -23,04   | 4,91     | 0,02     | 40,80    | 61,46    |
| IBRX 50                  | -11,67 | -5,71  | -18,35  | -5,71   | -22,70   | 6,28     | -1,09    | 35,60    | 56,73    |
| SMALL CAP                | -16,33 | -19,69 | -24,72  | -19,69  | -39,59   | -15,65   | -11,30   | 25,69    | 43,26    |
| IFIX                     | -0,88  | -0,33  | 0,56    | -0,33   | 1,48     | -0,38    | 6,46     | 31,54    | 34,78    |
| Índice Consumo - ICON    | -14,29 |        | -28,67  |         | -46,23   | -37,15   | -28,35   | -3,87    | -2,44    |
| Índice Dividendos - IDIV | -8,38  | 4,58   | -9,43   | 4,58    | -4,10    | 18,72    | 18,53    | 75,13    | 90,63    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Indicadores Econômicos**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,67   | 5,49   | 2,22    | 5,49    | 11,89    | 21,23    | 23,81    | 27,98    | 33,60    |
| INPC      | 0,62   | 5,61   | 2,12    | 5,61    | 11,92    | 22,24    | 25,11    | 29,26    | 33,82    |
| IGPM      | 0,59   | 8,16   | 2,54    | 8,16    | 10,70    | 50,28    | 61,27    | 71,77    | 83,66    |
| SELIC     | 1,01   | 5,40   | 2,91    | 5,40    | 8,66     | 11,12    | 16,25    | 23,60    | 32,72    |

**Investimentos no Exterior**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500   | 1,47   | -25,45 | -7,62   | -25,45  | -7,76    | 16,79    | 75,88    | 89,17    | 147,32   |
| MSCI ACWI | 1,26   | -25,79 | -7,28   | -25,79  | -13,20   | 8,75     | 55,83    | 60,47    | 103,16   |

**Meta Atuarial**

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,00   | 7,54   | 3,21    | 7,54    | 16,36    | 31,10    | 39,27    | 49,65    | 62,39    |
| IPCA + 5,00% | 1,08   | 8,05   | 3,45    | 8,05    | 17,48    | 33,63    | 43,33    | 55,47    | 70,31    |
| IPCA + 5,50% | 1,12   | 8,30   | 3,57    | 8,30    | 18,04    | 34,90    | 45,38    | 58,44    | 74,39    |
| IPCA + 5,89% | 1,15   | 8,50   | 3,66    | 8,50    | 18,48    | 35,90    | 47,00    | 60,79    | 77,62    |
| IPCA + 6,00% | 1,16   | 8,56   | 3,69    | 8,56    | 18,60    | 36,18    | 47,46    | 61,46    | 78,54    |
| INPC + 4,00% | 0,95   | 7,67   | 3,11    | 7,67    | 16,40    | 32,20    | 40,73    | 51,14    | 62,66    |
| INPC + 6,00% | 1,11   | 8,68   | 3,60    | 8,68    | 18,63    | 37,32    | 49,01    | 63,07    | 78,83    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR          | Data       | Ativo  | Aplicação            | Resgate              | Quantidade         | Valor Cota       |
|--------------|------------|--|----------------------|----------------------|--------------------|------------------|
| 24           | 14/06/2022 | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF             | 0,00                 | 673.369,28           | 261.944,70451773   | 2,5706543000     |
| 28           | 15/06/2022 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 0,00                 | 1.351.603,62         | 858.996,57174400   | 1,5734680000     |
| 29           | 15/06/2022 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 0,00                 | 1.399.975,57         | 889.738,82316400   | 1,5734680000     |
| 23           | 15/06/2022 | SOMMA BRASIL FIA                             | 1.000.000,00         | 0,00                 | 637.562,69472750   | 1,5684732000     |
| 25           | 17/06/2022 | TARPON GT 30 FIC FIA                         | 2.000.000,00         | 0,00                 | 1.436.011,32116861 | 1,3927466800     |
| 26           | 20/06/2022 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI             | 0,00                 | 9.519.829,51         | 6.028.061,90983700 | 1,5792521130     |
| 27           | 20/06/2022 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI             | 0,00                 | 4.514.484,28         | 2.858.621,64934776 | 1,5792521130     |
| 30           | 23/06/2022 | NTN-B 150840 (5,800000%)                     | 15.599.688,87        | 0,00                 | 3.755,00000000     | 4.154,3778615180 |
| <b>Total</b> |            |  | <b>18.599.688,87</b> | <b>17.459.262,26</b> |                    |                  |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.658.967,99

Value-At-Risk: 1,35%

|          | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|----------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| LINHARES |                             | 1,35               | 1,35                |        |       | 344.886.681,56 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,89%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo                    | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| NTN-B 150822 (6,750000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 2.095.774,89  | 0,61       |
| NTN-B 150523 (5,850000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 2.646.317,37  | 0,77       |
| NTN-B 150523 (6,050000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 3.139.966,44  | 0,91       |
| NTN-B 150535 (3,200000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 1.115.823,07  | 0,32       |
| NTN-B 150535 (4,410000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 1.105.303,09  | 0,32       |
| NTN-B 150535 (5,640000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 2.443.531,66  | 0,71       |
| NTN-B 150824 (5,800000%) |                             | 0,25               | -0,00               | 0,28                |        |       | 1.464.256,85  | 0,42       |
| NTN-B 150828 (5,200000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 4.258.383,18  | 1,23       |
| NTN-B 150828 (5,270000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 2.094.491,72  | 0,61       |
| NTN-B 150828 (5,500000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 5.420.193,54  | 1,57       |
| NTN-B 150830 (4,800000%) |                             | 0,12               | 0,00                | 0,15                |        |       | 5.481.983,42  | 1,59       |
| NTN-B 150832 (5,350000%) |                             | 0,24               | -0,00               | 0,27                |        |       | 1.875.827,44  | 0,54       |
| NTN-B 150840 (5,800000%) |                             | 0,24               | -0,00               | 0,27                |        |       | 15.647.533,63 | 4,54       |
| <b>Sub-total</b>         | 0,37                        | 0,13               | -0,00               |                     | -0,13  | 0,97  | 48.789.386,30 | 14,15      |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo                                     | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    |                             | 0,05               | -0,00               | 0,05                |        |       | 1.256.937,12  | 0,36       |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B       |                             | 2,26               | 0,11                | 0,20                |        |       | 21.011.149,39 | 6,09       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI |                             | 0,26               | 0,00                | 0,01                |        |       | 3.082.603,07  | 0,89       |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe       | Rent.       | Valor(R\$)            | % Carteira   |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------|
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                |                             | 2,15               | 0,09                | 0,03                |              |             | 18.292.592,55         | 5,30         |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        |                             | 2,18               | 0,10                | 0,04                |              |             | 18.611.138,88         | 5,40         |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         |                             | 0,26               | 0,00                | 0,01                |              |             | 385.331,88            | 0,11         |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      |                             | 1,11               | 0,05                | 0,02                |              |             | 22.398.235,70         | 6,49         |
| BB PREV RF IDKA2                                    |                             | 1,29               | 0,04                | 0,28                |              |             | 15.877.121,03         | 4,60         |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP |                             | 1,39               | 0,09                | 0,37                |              |             | 29.082.138,20         | 8,43         |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                    |                             | NaN                | 0,00                | NaN                 |              |             | 0,00                  | 0,00         |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                        |                             | 1,14               | 0,03                | 0,03                |              |             | 11.791.815,84         | 3,42         |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                   |                             | 0,18               | 0,00                | 0,08                |              |             | 1.041.808,53          | 0,30         |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI                   |                             | 0,97               | 0,01                | 1,65                |              |             | 3.215.748,50          | 0,93         |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    |                             | NaN                | 0,00                | NaN                 |              |             | 0,00                  | 0,00         |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        |                             | NaN                | 0,00                | NaN                 |              |             | 0,00                  | 0,00         |
| BNB IMA-B FI RF                                     |                             | 1,97               | 0,01                | 0,20                |              |             | 1.088.672,75          | 0,32         |
| <b>Sub-total</b>                                    | <b>3,07</b>                 | <b>1,51</b>        | <b>0,53</b>         |                     | <b>-0,32</b> | <b>0,03</b> | <b>147.135.293,44</b> | <b>42,66</b> |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe       | Rent.       | Valor(R\$)           | % Carteira   |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|----------------------|--------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  |                             | 0,04               | -0,00               | 0,04                |              |             | 11.401.008,43        | 3,31         |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                   |                             | 2,09               | 0,08                | 0,21                |              |             | 15.957.309,60        | 4,63         |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             |                             | 0,03               | 0,00                | 0,02                |              |             | 27.203.888,19        | 7,89         |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI        |                             | 0,04               | 0,00                | 0,04                |              |             | 8.727.690,83         | 2,53         |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI   |                             | 0,04               | 0,00                | 0,04                |              |             | 15.472.899,92        | 4,49         |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF               |                             | 0,31               | 0,01                | 0,31                |              |             | 13.634.122,63        | 3,95         |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI |                             | 0,81               | 0,01                | 0,81                |              |             | 6.754.954,44         | 1,96         |
| BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO         |                             | 0,05               | 0,00                | 0,04                |              |             | 682.447,50           | 0,20         |
| <b>Sub-total</b>                               | <b>0,92</b>                 | <b>0,43</b>        | <b>0,10</b>         |                     | <b>-0,30</b> | <b>0,74</b> | <b>99.834.321,54</b> | <b>28,95</b> |

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,11%

Artigo 8º I

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent.  | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|--------|---------------|------------|
| FIA CAIXA DIVIDENDOS                                   |                             | 7,63               | 0,03                | 5,33                |        |        | 1.722.284,81  | 0,50       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                     |                             | 8,66               | 0,01                | 5,54                |        |        | 675.256,54    | 0,20       |
| SOMMA BRASIL FIA                                       |                             | 9,48               | 0,04                | 1,75                |        |        | 1.813.481,69  | 0,53       |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS       |                             | 8,00               | 0,31                | 2,29                |        |        | 16.136.883,49 | 4,68       |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL |                             | 10,04              | 0,12                | 6,64                |        |        | 5.090.624,51  | 1,48       |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA                            |                             | 7,83               | 0,03                | 4,66                |        |        | 1.584.313,30  | 0,46       |
| BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI                           |                             | 9,90               | 0,07                | 2,56                |        |        | 3.580.376,49  | 1,04       |
| TARPON GT 30 FIC FIA                                   |                             | 9,41               | 0,04                | 8,07                |        |        | 1.922.133,21  | 0,56       |
| <b>Sub-total</b>                                       | 15,41                       | 8,11               | 0,65                |                     | -0,72  | -10,12 | 32.525.354,04 | 9,43       |

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,87%

Artigo 10º I

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)   | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO |                             | 2,32               | -0,01               | 11,56               |        |       | 2.039.184,66 | 0,59       |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO                          |                             | 3,07               | 0,02                | 3,07                |        |       | 2.993.232,85 | 0,87       |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                               |                             | 2,69               | 0,02                | 8,75                |        |       | 4.310.831,17 | 1,25       |
| <b>Sub-total</b>   | 2,63                        | 1,87               | 0,04                |                     | -0,87  | -1,27 | 9.343.248,68 | 2,71       |

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,67%

Artigo 9º II

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)   | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE                                |                             | 12,60              | -0,00               | 14,28               |        |       | 2.148.614,42 | 0,62       |
| GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE                                    |                             | 30,72              | 0,03                | 29,02               |        |       | 957.011,12   | 0,28       |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR |                             | 17,58              | 0,01                | 17,58               |        |       | 504.946,73   | 0,15       |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE             |                             | 11,28              | 0,00                | 14,42               |        |       | 3.648.505,29 | 1,06       |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo            | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)   | % Carteira |
|------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| <b>Sub-total</b> | 27,14                       | 12,67              | 0,03                |                     | -0,01  | 0,65  | 7.259.077,56 | 2,10       |