



**HOLAMBRA**  
DEZEMBRO 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 30.12.2022.

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

RENTA FIXA 97,79%

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

| Gestor                          | Admin.    | Ativo                                               | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |       |       | Valor (R\$)   | % Carteira | PL do Fundo       | % Fundo |
|---------------------------------|-----------|-----------------------------------------------------|------------------------|-------------------|-------|-------|---------------|------------|-------------------|---------|
|                                 |           |                                                     |                        | Dia               | Mês   | Ano   |               |            |                   |         |
| CAIXA DTVM                      | CEF       | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 0,10                   | 0,05              | 1,09  | 12,43 | 5.464.774,01  | 6,09       | 16.549.368.546,86 | 0,03    |
| BB                              | BB        | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,48                   | 0,05              | 1,16  | 11,73 | 12.936.825,69 | 14,41      | 6.516.931.621,39  | 0,20    |
| BB                              | BB        | BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | 5,32                   | 0,04              | -0,22 | 6,09  | 9.500.684,19  | 10,58      | 6.078.064.149,48  | 0,16    |
| CAIXA DTVM                      | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 5,40                   | 0,04              | -0,24 | 6,19  | 3.539.555,77  | 3,94       | 3.466.339.701,42  | 0,10    |
| CAIXA DTVM                      | CEF       | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,48                   | 0,05              | 0,77  | 0,77  | 210.204,87    | 0,23       | 6.557.713.378,25  | 0,00    |
| BRAM                            | BRADESCO  | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS             | 0,48                   | 0,05              | 1,15  | 11,78 | 2.673.261,83  | 2,98       | 554.964.817,38    | 0,48    |
| CAIXA DTVM                      | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 2,60                   | 0,04              | 0,92  | 9,67  | 3.871.449,27  | 4,31       | 7.960.289.495,76  | 0,05    |
| BB                              | BB        | BB PREV RF IDKA2                                    | 2,82                   | 0,04              | 1,22  | 9,32  | 14.574.833,46 | 16,24      | 7.489.389.892,90  | 0,19    |
| BB                              | BB        | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              | 8,38                   | 0,04              | -1,19 | 2,95  | 2.061.474,16  | 2,30       | 830.239.076,41    | 0,25    |
| SANTANDER                       | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI                 | 2,61                   | 0,04              | 0,92  | 9,57  | 2.622.318,37  | 2,92       | 827.149.677,31    | 0,32    |
| CAIXA DTVM                      | CEF       | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,92                   | 0,04              | 1,23  | 2,59  | 3.095.759,38  | 3,45       | 6.893.208.496,34  | 0,04    |
| CAIXA DTVM                      | CEF       | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 1,78                   | 0,05              | 1,14  | 10,70 | 1.145.118,67  | 1,28       | 5.292.657.963,96  | 0,02    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b |           |                                                     | 2,58                   | 0,05              | 0,78  | 9,04  | 61.696.259,67 | 68,73      |                   |         |

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

| Gestor  | Admin.   | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |       |       | Valor (R\$)  | % Carteira | PL do Fundo       | % Fundo |
|---------|----------|------------------------------------------|------------------------|-------------------|-------|-------|--------------|------------|-------------------|---------|
|         |          |                                          |                        | Dia               | Mês   | Ano   |              |            |                   |         |
| GRAPHEN | RJI      | LME REC IMA B FI RENDA FIXA              | 1,41                   | 0,03              | 0,20  | 6,22  | 1.562.089,09 | 1,74       | 72.334.055,99     | 2,16    |
| BRAM    | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 5,37                   | 0,04              | -0,27 | 5,95  | 738.173,66   | 0,82       | 335.796.983,50    | 0,22    |
| BB      | BB       | BB PREV RF IMA-B                         | 5,36                   | 0,04              | -0,24 | 6,06  | 3.438.459,09 | 3,83       | 640.688.864,31    | 0,54    |
| BB      | BB       | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI       | 0,09                   | 0,05              | 1,12  | 12,59 | 8.590.160,74 | 9,57       | 12.858.761.791,29 | 0,07    |
| BRAM    | BRADESCO | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5          | 2,63                   | 0,04              | 0,93  | 9,29  | 542.568,06   | 0,60       | 926.201.488,19    | 0,06    |
| BRAM    | BRADESCO | BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA     | 2,78                   | 0,05              | 0,73  | 8,75  | 1.111.553,75 | 1,24       | 737.700.765,07    | 0,15    |
| BRAM    | BRADESCO | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL   | 0,09                   | 0,05              | 1,11  | 12,07 | 3.165.020,35 | 3,53       | 8.145.512.045,19  | 0,04    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                   | Admin.   | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |      |       | Valor (R\$)   | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|------------------------------------------|----------|----------------------------------------|------------------------|-------------------|------|-------|---------------|------------|------------------|---------|
|                                          |          |                                        |                        | Dia               | Mês  | Ano   |               |            |                  |         |
|                                          |          | EXTRA                                  |                        |                   |      |       |               |            |                  |         |
| BRAM                                     | BRABESCO | BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,09                   | 0,05              | 1,17 | 13,00 | 5.833.715,08  | 6,50       | 7.627.582.136,16 | 0,08    |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a        |          |                                        | 1,13                   | 0,05              | 0,82 | 10,81 | 24.981.739,82 | 27,83      |                  |         |
| Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior) |          |                                        |                        |                   |      |       |               |            |                  |         |
| Gestor                                   | Admin.   | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |      |       | Valor (R\$)   | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|                                          |          |                                        |                        | Dia               | Mês  | Ano   |               |            |                  |         |
| GRAPHEN                                  | RJI      | LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC          | 1,26                   | 0,19              | 0,19 | 3,39  | 1.110.171,71  | 1,24       | 74.553.671,31    | 1,49    |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a          |          |                                        | 1,26                   | 0,19              | 0,19 | 3,39  | 1.110.171,71  | 1,24       |                  |         |
|                                          |          | Renda Fixa                             | 2,13                   | 0,05              | 0,78 | 9,47  | 87.788.171,20 | 97,79      |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,21%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor                        | Admin. | Ativo                      | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |              | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|-------------------------------|--------|----------------------------|------------------------|-------------------|-------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
|                               |        |                            |                        | Dia               | Mês         | Ano          |                     |             |                |         |
| BB                            | BB     | BB PREV MULTIMERCADO FI LP | 1,02                   | 0,05              | 1,05        | 11,78        | 1.983.025,39        | 2,21        | 312.034.985,02 | 0,64    |
| <b>Sub-total Artigo 10º I</b> |        |                            | <b>1,02</b>            | <b>0,05</b>       | <b>1,05</b> | <b>11,78</b> | <b>1.983.025,39</b> | <b>2,21</b> |                |         |
| Investimentos Estruturados    |        |                            | 1,02                   | 0,05              | 1,05        | 11,78        | 1.983.025,39        | 2,21        |                |         |
| Total                         |        |                            | 2,09                   | 0,05              | 0,79        | 9,52         | 89.771.196,59       | 100,00      |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

| Política de Investimentos  |                                  |               |            |        |          |        |      |              |
|----------------------------|----------------------------------|---------------|------------|--------|----------|--------|------|--------------|
| Artigo                     | Tipo de Ativo                    | Valor(R\$)    | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM  | Limite Legal |
| Renda Fixa                 |                                  |               |            |        |          |        |      |              |
| Artigo 7º I, Alínea b      | Fundos 100% Títulos Públicos     | 61.696.259,67 | 68,73      | 0,00   | 62,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a    | Fundos Renda Fixa                | 24.981.739,82 | 27,83      | 0,00   | 34,00    | 60,00  | 0,00 | 60,00        |
| Artigo 7º V, Alínea a      | FIDC Cota Sênior                 | 1.110.171,71  | 1,24       | 0,00   | 2,00     | 5,00   | 0,00 | 5,00         |
|                            | Total Renda Fixa                 | 87.788.171,20 | 97,79      |        |          |        |      | 100,00       |
| Investimentos Estruturados |                                  |               |            |        |          |        |      |              |
| Artigo 10º I               | Fundos Multimercados             | 1.983.025,39  | 2,21       | 0,00   | 2,00     | 10,00  | 0,00 | 10,00        |
|                            | Total Investimentos Estruturados | 1.983.025,39  | 2,21       |        |          |        |      | 15,00        |
| Total                      |                                  | 89.771.196,59 | 100,00     |        |          |        |      |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador                | No Mês        | No Ano         | 3 meses       | 6 meses       | 12 meses       | No Mês(R\$)       | No Ano(R\$)         |
|-------------------------------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|-------------------|---------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI   | 0,78<br>69,61 | 9,04<br>73,10  | 2,00<br>62,67 | 3,73<br>56,36 | 9,04<br>73,10  | 467.571,13        | 5.036.258,94        |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 0,82<br>73,01 | 10,81<br>87,36 | 2,50<br>78,07 | 5,41<br>81,83 | 10,81<br>87,36 | 203.211,27        | 2.436.084,43        |
| Artigo 7º V, Alínea a<br>% do CDI   | 0,19<br>16,64 | 3,39<br>27,37  | 0,43<br>13,40 | 0,68<br>10,30 | 3,39<br>27,37  | 2.071,74          | 36.362,86           |
| Artigo 10º I<br>% do CDI            | 1,05<br>93,70 | 11,78<br>95,17 | 2,77<br>86,76 | 6,52<br>98,64 | 11,78<br>95,17 | 20.655,33         | 208.916,79          |
| <b>HOLAMBRA (Total)</b>             |               |                |               |               |                | <b>693.509,47</b> | <b>7.717.623,02</b> |

### RESULTADO POR ATIVO

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

| Ativo                                               | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates      | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------|---------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF IDKA2                                    | 14.399.360,37  | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 14.574.833,46 | 175.473,09                  | 1.242.729,91                |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | 9.521.450,42   | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 9.500.684,19  | -20.766,23                  | 728.302,31                  |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              | 2.086.282,46   | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 2.061.474,16  | -24.808,30                  | 55.451,40                   |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 11.162.112,13  | 1.729.800,86 | -88.407,66    | 0,00        | 12.936.825,69 | 133.320,36                  | 1.137.625,09                |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS             | 2.642.776,48   | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 2.673.261,83  | 30.485,35                   | 281.692,51                  |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.053.395,93   | 0,00         | -1.000.000,00 | 0,00        | 3.095.759,38  | 42.363,45                   | 95.759,38                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 4.135.576,08   | 0,00         | -300.000,00   | 0,00        | 3.871.449,27  | 35.873,19                   | 157.665,46                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 3.262.013,03   | 294.000,00   | -13.111,99    | 0,00        | 3.539.555,77  | -3.345,27                   | 199.903,13                  |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,00           | 1.000.000,00 | -792.716,97   | 0,00        | 210.204,87    | 2.921,84                    | 134.201,05                  |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 5.405.624,93   | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 5.464.774,01  | 59.149,08                   | 626.464,87                  |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 1.132.219,62   | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 1.145.118,67  | 12.899,05                   | 147.533,79                  |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI                 | 2.598.312,85   | 0,00         | 0,00          | 0,00        | 2.622.318,37  | 24.005,52                   | 228.930,04                  |
|                                                     |                |              |               |             | 61.696.259,67 | 0,00                        | 0,00                        |

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                        | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA | 3.130.388,50   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.165.020,35  | 34.631,85                      | 340.820,58                     |
| BB PREV RF IMA-B                             | 3.446.621,92   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.438.459,09  | -8.162,83                      | 196.326,53                     |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI           | 8.494.813,94   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 8.590.160,74  | 95.346,80                      | 959.413,09                     |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM       | 5.766.485,88   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.833.715,08  | 67.229,20                      | 671.064,71                     |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA         | 1.103.514,83   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.111.553,75  | 8.038,92                       | 89.432,46                      |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5              | 537.582,86     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 542.568,06    | 4.985,20                       | 46.141,31                      |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B     | 740.147,67     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 738.173,66    | -1.974,01                      | 41.480,22                      |
| LME REC IMA B FI RENDA FIXA                  | 1.558.972,95   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.562.089,09  | 3.116,14                       | 91.405,53                      |
|                                              |                |            |          |             | 24.981.739,82 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

| Ativo                         | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | 1.108.099,97   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.110.171,71 | 2.071,74                       | 36.362,86                      |
|                               |                |            |          |             | 1.110.171,71 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo                      | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB PREV MULTIMERCADO FI LP | 1.962.370,06   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.983.025,39 | 20.655,33                      | 208.916,79                     |
|                            |                |            |          |             | 1.983.025,39 | 0,00                           | 0,00                           |

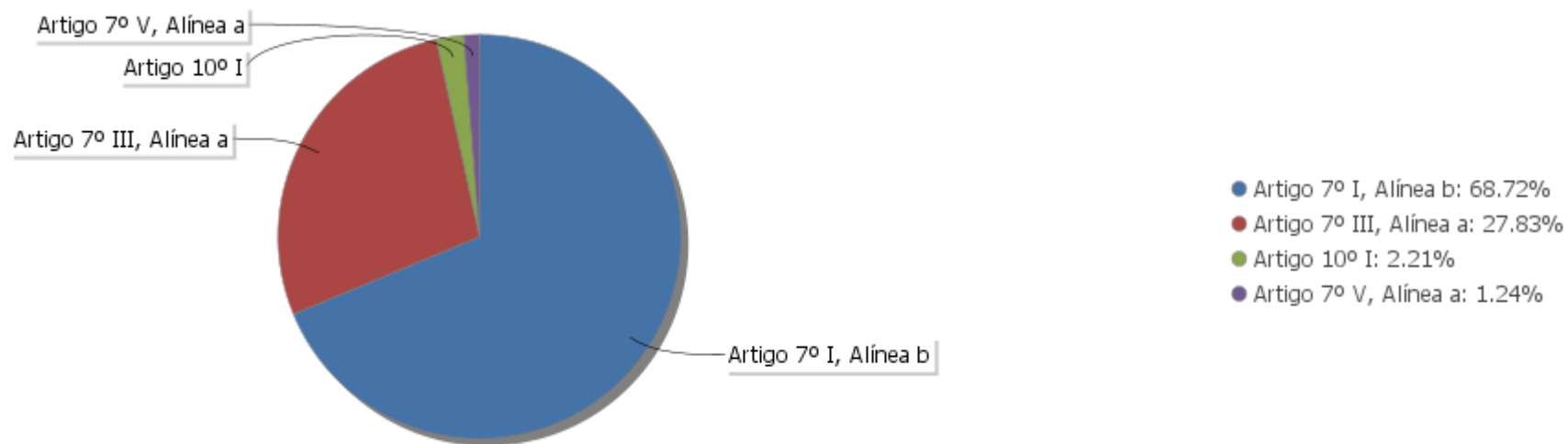
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

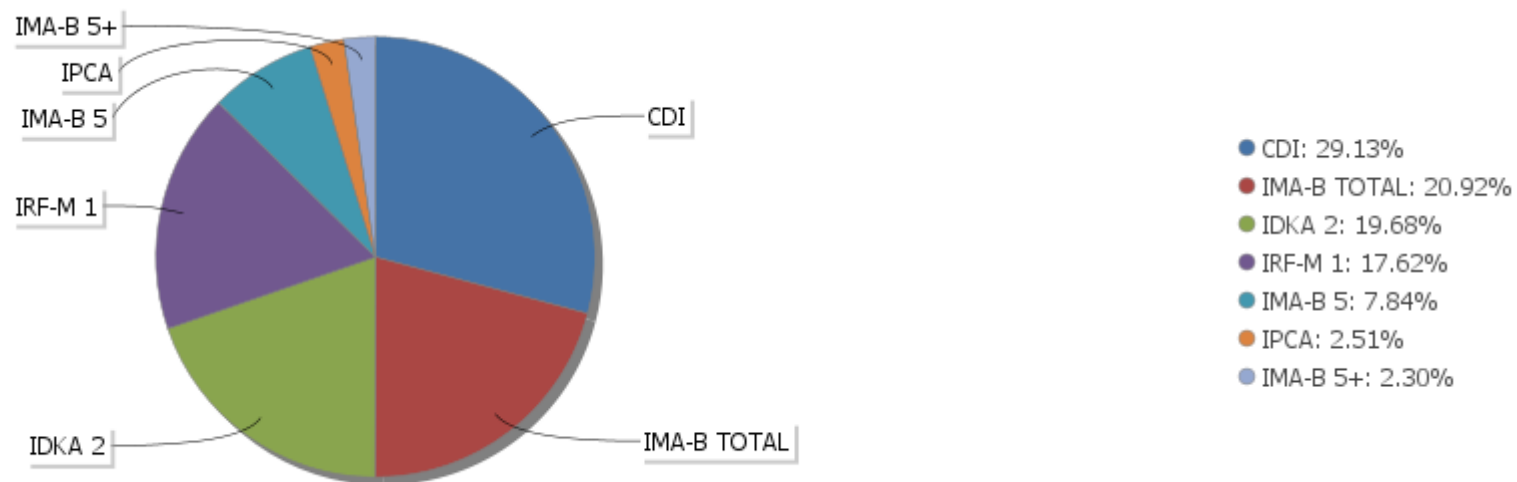
| Período           | Valor (R\$)   | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 88.209.107,50 | 98,26 | 88.209.107,50         | 98,26     |
| de 31 a 365 dias  | 0,00          | 0,00  | 88.209.107,50         | 98,26     |
| acima de 365 dias | 1.562.089,09  | 1,74  | 89.771.196,59         | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

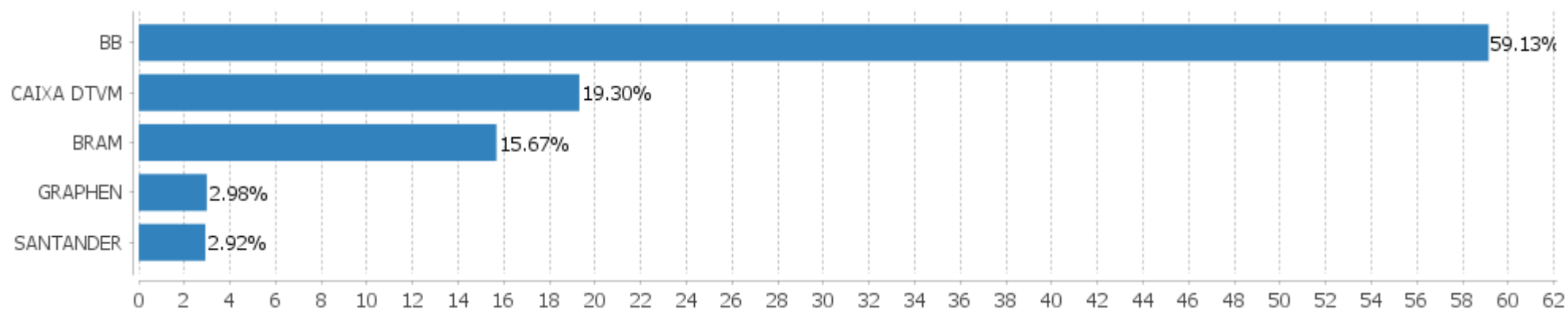


### Alocação Por Estratégia



## 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           | 0,15  | 0,76  | 1,84  | 0,90  | 0,93  | 0,42  | 0,19  | 0,82  | 1,01  | 1,27  | 0,07  | 0,79  | 9,52      |
| IPCA + 5,04%   | 0,95  | 1,39  | 2,06  | 1,44  | 0,90  | 1,08  | -0,27 | 0,09  | 0,12  | 0,98  | 0,80  | 1,05  | 11,10     |
| p.p. indexador | -0,81 | -0,62 | -0,22 | -0,54 | 0,03  | -0,67 | 0,47  | 0,73  | 0,89  | 0,29  | -0,74 | -0,26 | -1,58     |
| 2021           | -0,40 | -0,96 | -0,15 | 0,60  | 0,73  | 0,23  | -0,18 | -0,59 | 0,19  | -0,96 | 1,83  | 0,58  | 0,88      |
| IPCA + 5,89%   | 0,71  | 1,27  | 1,46  | 0,77  | 1,31  | 1,01  | 1,47  | 1,38  | 1,64  | 1,71  | 1,41  | 1,26  | 16,52     |
| p.p. indexador | -1,10 | -2,23 | -1,61 | -0,17 | -0,58 | -0,78 | -1,65 | -1,96 | -1,46 | -2,67 | 0,42  | -0,68 | -15,64    |
| 2020           | 0,34  | 0,42  | -3,58 | 0,77  | 1,31  | 1,28  | 2,29  | -0,74 | -0,80 | 0,16  | 1,32  | 2,83  | 5,58      |
| IPCA + 5,89%   | 0,71  | 0,66  | 0,57  | 0,14  | 0,07  | 0,74  | 0,89  | 0,72  | 1,12  | 1,34  | 1,35  | 1,86  | 10,65     |
| p.p. indexador | -0,37 | -0,24 | -4,15 | 0,63  | 1,23  | 0,54  | 1,41  | -1,46 | -1,92 | -1,18 | -0,03 | 0,98  | -5,06     |
| 2019           | 1,30  | 0,44  | 0,54  | 0,92  | 1,53  | 1,62  | 0,95  | -0,04 | 1,82  | 2,02  | -1,07 | 1,27  | 11,86     |
| IPCA + 6,00%   | 0,83  | 0,90  | 1,19  | 1,06  | 0,64  | 0,45  | 0,72  | 0,62  | 0,45  | 0,63  | 0,98  | 1,64  | 10,59     |
| p.p. indexador | 0,46  | -0,46 | -0,65 | -0,14 | 0,89  | 1,17  | 0,23  | -0,66 | 1,37  | 1,39  | -2,04 | -0,37 | 1,27      |
| 2018           | 1,05  | 0,52  | 0,97  | 0,44  | -0,69 | 0,36  | 1,07  | 1,13  | 0,63  | 2,13  | 0,42  | 0,91  | 9,28      |
| IPCA + 6,00%   | 0,80  | 0,74  | 0,58  | 0,71  | 0,89  | 1,75  | 0,84  | 0,44  | 0,92  | 0,96  | 0,25  | 0,61  | 9,92      |
| p.p. indexador | 0,25  | -0,22 | 0,39  | -0,26 | -1,58 | -1,40 | 0,23  | 0,69  | -0,29 | 1,17  | 0,16  | 0,29  | -0,64     |

### Performance Sobre a Meta Atuarial

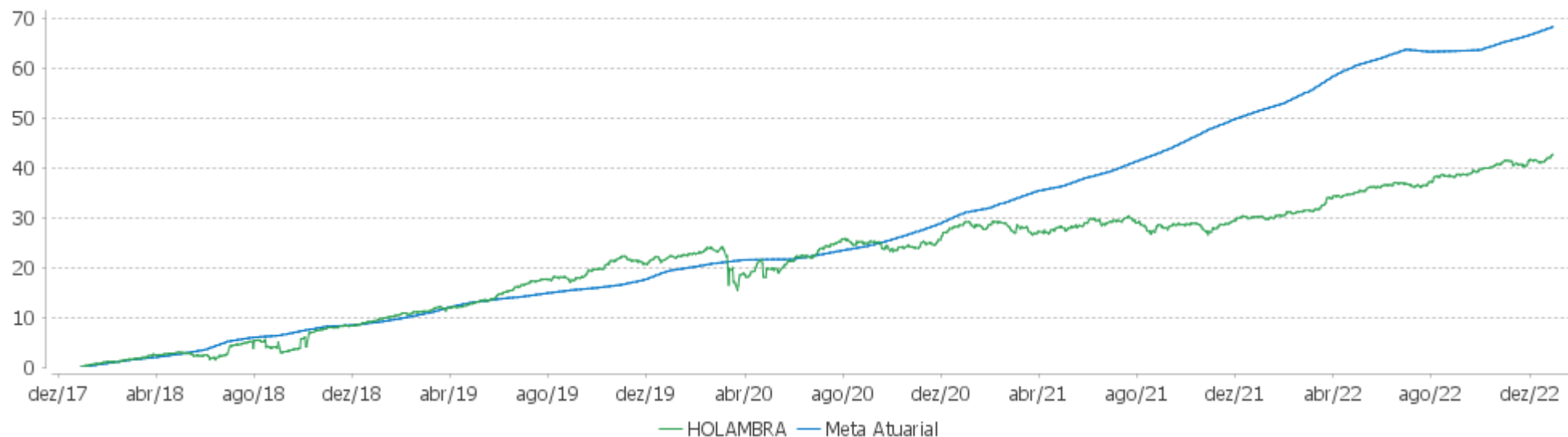
### Relatório

|                              | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 24         | 40,00     | 03 meses         | 2,14     | 2,87          | -0,73      | 2,40               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 36         | 60,00     | 06 meses         | 4,22     | 2,80          | 1,42       | 2,29               |
|                              |            |           | 12 meses         | 9,52     | 11,10         | -1,58      | 2,09               |
|                              |            |           | 24 meses         | 10,48    | 29,44         | -18,97     | 2,74               |
|                              |            |           | 36 meses         | 16,65    | 43,23         | -26,58     | 4,59               |
|                              |            |           | 48 meses         | 30,49    | 58,40         | -27,91     | 4,11               |
|                              |            |           | 60 meses         | 42,59    | 74,11         | -31,52     | 4,35               |
|                              |            |           | Desde 29/12/2017 | 42,59    | 74,11         | -31,52     | 4,35               |

|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,83          | 2020-12 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,58         | 2020-03 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

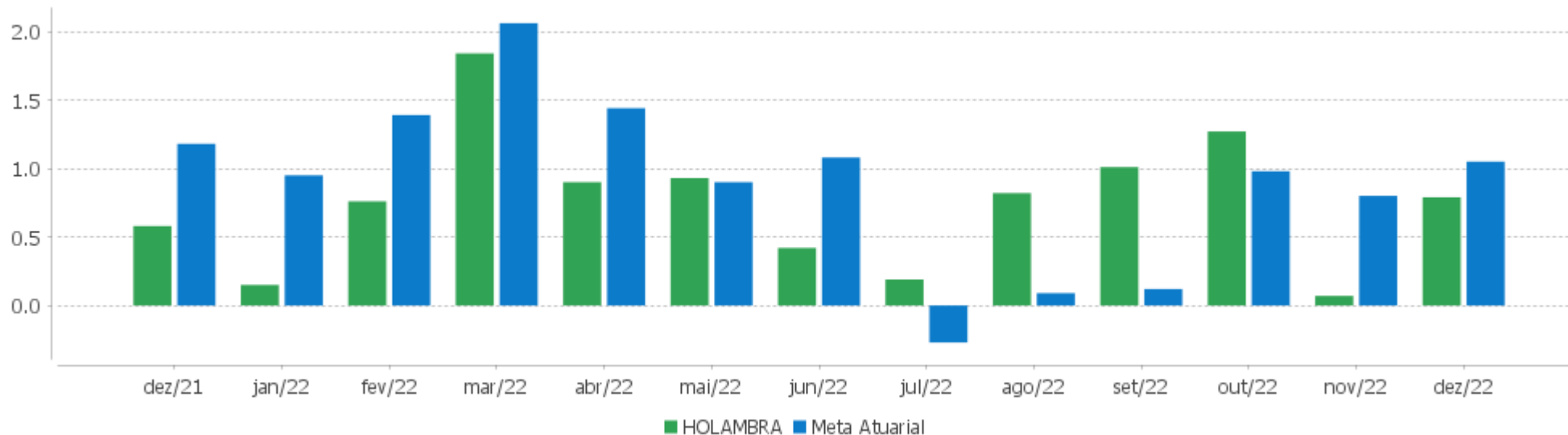


### Patrimônio Líquido



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        |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | -0,24<br>-0,04 | 6,19<br>-0,17   | 0,10<br>-0,13  | 1,86<br>-0,07  | 6,19<br>-0,17   | 4,57<br>-0,45   | 10,91<br>-0,84  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.     | 0,92<br>-0,02  | 9,67<br>-0,11   | 2,46<br>-0,07  | 2,96<br>-0,01  | 9,67<br>-0,11   | 14,40<br>-0,40  | 23,26<br>-0,76  |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.                | 0,92<br>-0,02  | 9,57<br>-0,22   | 2,48<br>-0,05  | 2,88<br>-0,10  | 9,57<br>-0,22   | 14,33<br>-0,46  | 23,29<br>-0,74  |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.                                    | 1,22<br>-0,02  | 9,32<br>-0,02   | 2,42<br>0,17   | 2,69<br>0,36   | 9,32<br>-0,02   | 14,40<br>-0,38  | 23,46<br>-1,22  |
| BRANCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS<br>Var. IRF-M 1 p.p.              | 1,15<br>-0,03  | 11,78<br>-0,24  | 3,10<br>-0,06  | 6,59<br>-0,11  | 11,78<br>-0,24  | 14,75<br>-0,55  | 18,74<br>-0,98  |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.          | 1,14<br>0,52   | 10,70<br>4,91   | 2,23<br>0,60   | 5,84<br>5,56   | 10,70<br>4,91   | 10,58<br>-5,85  | 17,95<br>-3,74  |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.          | 1,16<br>-0,02  | 11,73<br>-0,29  | 3,09<br>-0,07  | 6,56<br>-0,14  | 11,73<br>-0,29  | 14,68<br>-0,62  | 18,66<br>-1,07  |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p. | 1,23<br>-0,01  | 9,04<br>-0,30   | 2,36<br>0,11   | 2,47<br>0,13   | 9,04<br>-0,30   | 14,12<br>-0,66  | 23,29<br>-1,38  |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.        | 1,15<br>-0,02  | 11,74<br>-0,28  | 3,09<br>-0,06  | 6,56<br>-0,13  | 11,74<br>-0,28  | 14,76<br>-0,54  | 18,92<br>-0,80  |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | -0,22<br>-0,02 | 6,09<br>-0,28   | 0,17<br>-0,07  | 1,80<br>-0,14  | 6,09<br>-0,28   | 4,49<br>-0,54   | 10,90<br>-0,85  |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>% do CDI                      | 1,09<br>97,41  | 12,43<br>100,42 | 3,12<br>97,45  | 6,55<br>98,96  | 12,43<br>100,42 | 17,30<br>99,95  | 20,18<br>98,18  |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B 5+ p.p.            | -1,19<br>0,00  | 2,95<br>-0,35   | -1,79<br>-0,07 | 1,07<br>-0,17  | 2,95<br>-0,35   | -4,03<br>-0,56  | 0,83<br>-1,01   |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC<br>% do CDI                               | 0,19<br>16,64  | 3,39<br>27,37   | 0,43<br>13,40  | 0,68<br>10,30  | 3,39<br>27,37   | 2,55<br>14,70   | -2,29<br>-11,14 |
| BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.         | -0,27<br>-0,07 | 5,95<br>-0,42   | 0,03<br>-0,20  | 1,67<br>-0,27  | 5,95<br>-0,42   | 3,48<br>-1,55   | 10,00<br>-1,75  |
| BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5<br>Var. IMA-B 5 p.p.                      | 0,93<br>-0,01  | 9,29<br>-0,49   | 2,41<br>-0,12  | 2,80<br>-0,17  | 9,29<br>-0,49   | 13,30<br>-1,49  | 22,20<br>-1,82  |
| BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM<br>% do CDI                        | 1,17<br>103,79 | 13,00<br>105,05 | 3,34<br>104,31 | 6,89<br>104,19 | 13,00<br>105,05 | 18,58<br>107,34 | 21,11<br>102,67 |
| BB PREV RF IMA-B                                                        | -0,24          | 6,06            | 0,17           | 1,72           | 6,06            | 4,49            | 10,67           |

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.                                    | -0,04         | -0,31           | -0,06          | -0,22          | -0,31           | -0,53           | -1,08           |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI           | 1,12<br>99,92 | 12,59<br>101,73 | 3,22<br>100,61 | 6,67<br>100,91 | 12,59<br>101,73 | 17,79<br>102,78 | 20,62<br>100,29 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA<br>% do CDI | 1,11<br>98,49 | 12,07<br>97,53  | 3,14<br>98,17  | 6,49<br>98,20  | 12,07<br>97,53  | 16,86<br>97,38  | 19,65<br>95,58  |
| LME REC IMA B FI RENDA FIXA<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.     | 0,20<br>0,39  | 6,22<br>-0,15   | 1,37<br>1,13   | 2,85<br>0,91   | 6,22<br>-0,15   | 1,88<br>-3,14   | -0,39<br>-12,14 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA<br>Var. IPCA p.p.   | 0,73<br>0,11  | 8,75<br>2,96    | 1,47<br>-0,16  | 4,49<br>4,21   | 8,75<br>2,96    | 8,58<br>-7,85   | 13,64<br>-8,04  |
| BB PREV MULTIMERCADO FI LP<br>% do CDI                   | 1,05<br>93,70 | 11,78<br>95,17  | 2,77<br>86,76  | 6,52<br>98,64  | 11,78<br>95,17  | 15,73<br>90,87  | 18,06<br>87,85  |
| HOLAMBRA<br>Var. IPCA + 5,04% p.p.                       | 0,79<br>-0,26 | 9,52<br>-1,58   | 2,14<br>-0,73  | 4,22<br>1,42   | 9,52<br>-1,58   | 10,48<br>-17,93 | 16,65<br>-24,30 |
| CDI                                                      | 1,12          | 12,37           | 3,20           | 6,61           | 12,37           | 17,31           | 20,56           |
| IBOVESPA                                                 | -2,45         | 4,69            | -0,27          | 11,36          | 4,69            | -7,80           | -5,11           |
| INPC + 6,00%                                             | 1,20          | 12,26           | 3,01           | 3,29           | 12,26           | 31,06           | 46,46           |
| IPCA + 6,00%                                             | 1,13          | 12,11           | 3,10           | 3,27           | 12,11           | 30,76           | 44,83           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Cotização e Taxas

| Fundo                                               | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas                                                                     |               |
|-----------------------------------------------------|-----------|------------|-----------|------------|---------------------------------------------------------------------------|---------------|
|                                                     | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance                                                               | Administração |
| BB PREV MULTIMERCADO FI LP                          | D+0       | D+0        | D+0       | D+4 du     |                                                                           | 0,60          |
| BB PREV RF IDKA2                                    | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |                                                                           | 0,20          |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |                                                                           | 0,20          |
| BB PREV RF IMA-B                                    | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |                                                                           | 0,30          |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              | D+0       | D+0        | D+2 du    | D+2 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          |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS             | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |                                                                           | 0,20          |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA        | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |                                                                           | 0,15          |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM              | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |                                                                           | 0,20          |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA                | D+0       | D+0        | D+3 du    | D+4 du     |                                                                           | 0,40          |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5                     | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |                                                                           | 0,20          |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B            | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |                                                                           | 0,20          |
| 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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |                                                                           | 0,20          |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |                                                                           | 0,40          |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC                       | D+0       | D+0        |           |            |                                                                           |               |
| LME REC IMA B FI RENDA FIXA                         | D+0       | D+0        | D+1008 du | D+1009 du  | PERÍODO SEMESTRAL, C / VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO. | 0,00          |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI                 | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |                                                                           | 0,10          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

## Renda Fixa

| Indexador       | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1         | 1,18   | 12,02  | 3,16    | 6,70    | 12,02    | 15,30    | 19,73    | 27,82    | 36,73    |
| IRF-M 1+        | 1,62   | 7,41   | 1,10    | 6,63    | 7,41     | 2,06     | 10,68    | 26,44    | 41,95    |
| IRF-M TOTAL     | 1,48   | 8,82   | 1,74    | 6,49    | 8,82     | 6,66     | 13,80    | 27,49    | 41,17    |
| IMA-B 5         | 0,94   | 9,78   | 2,53    | 2,98    | 9,78     | 14,79    | 24,02    | 40,34    | 54,18    |
| IMA-B 5+        | -1,19  | 3,30   | -1,72   | 1,24    | 3,30     | -3,47    | 1,84     | 32,76    | 53,22    |
| IMA-B TOTAL     | -0,19  | 6,37   | 0,23    | 1,94    | 6,37     | 5,02     | 11,75    | 37,40    | 55,34    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,77   | 9,66   | 1,73    | 4,95    | 9,66     | 10,71    | 16,62    | 31,57    | 44,78    |
| IDKA 2          | 1,24   | 9,34   | 2,25    | 2,34    | 9,34     | 14,78    | 24,67    | 39,41    | 53,01    |
| IDKA 20         | -3,32  | -1,92  | -5,66   | 0,71    | -1,92    | -16,13   | -14,29   | 23,65    | 48,88    |
| CDI             | 1,12   | 12,37  | 3,20    | 6,61    | 12,37    | 17,31    | 20,56    | 27,75    | 35,96    |

## Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -2,45  | 4,69   | -0,27   | 11,36   | 4,69     | -7,80    | -5,11    | 24,86    | 43,63    |
| IBRX 100                 | -2,63  | 4,02   | -0,39   | 10,33   | 4,02     | -7,61    | -4,37    | 27,56    | 47,23    |
| IBRX 50                  | -2,55  | 5,72   | 0,38    | 12,12   | 5,72     | -5,43    | -2,00    | 26,57    | 44,96    |
| SMALL CAP                | -3,01  | -15,06 | -7,61   | 5,76    | -15,06   | -28,82   | -29,28   | 11,87    | 20,97    |
| Índice Consumo - ICON    |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,61  | 12,65  | 3,15    | 7,71    | 12,65    | 5,43     | 4,37     | 51,51    | 75,68    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500   | -7,26  | -24,68 | 3,34    | 1,04    | -24,68   | 2,63     | 53,84    | 106,24   | 126,51   |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | -0,00  | 2,22   | -4,14   | 2,56    | 2,22     | -0,11    | -10,33   | 21,92    | 28,78    |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | -5,43  | -25,01 | 5,58    | 1,05    | -25,01   | -5,95    | 38,64    | 78,90    | 86,12    |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,62   | 5,79   | 1,63    | 0,28    | 5,79     | 16,43    | 21,69    | 26,93    | 31,68    |
| INPC      | 0,69   | 5,93   | 1,55    | 0,30    | 5,93     | 16,70    | 23,05    | 28,57    | 32,98    |
| IGPM      | 0,45   | 5,45   | -1,09   | -2,51   | 5,45     | 24,20    | 52,94    | 64,11    | 76,48    |
| SELIC     | 1,12   | 12,37  | 3,20    | 6,61    | 12,37    | 17,31    | 20,56    | 27,75    | 35,97    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,97   | 10,00  | 2,61    | 2,28    | 10,00    | 25,89    | 36,82    | 48,44    | 60,11    |
| IPCA + 5,00% | 1,05   | 11,05  | 2,86    | 2,78    | 11,05    | 28,31    | 40,79    | 54,22    | 67,93    |
| IPCA + 5,50% | 1,09   | 11,58  | 2,98    | 3,03    | 11,58    | 29,53    | 42,80    | 57,17    | 71,96    |
| IPCA + 5,89% | 1,12   | 11,99  | 3,07    | 3,22    | 11,99    | 30,49    | 44,38    | 59,51    | 75,15    |
| IPCA + 6,00% | 1,13   | 12,11  | 3,10    | 3,27    | 12,11    | 30,76    | 44,83    | 60,17    | 76,06    |
| INPC + 4,00% | 1,04   | 10,15  | 2,53    | 2,31    | 10,15    | 26,18    | 38,35    | 50,36    | 61,69    |
| INPC + 6,00% | 1,20   | 12,26  | 3,01    | 3,29    | 12,26    | 31,06    | 46,46    | 62,24    | 77,79    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

| APR          | Data       | Ativo                                               | Aplicação           | Resgate             | Quantidade       | Valor Cota   |
|--------------|------------|-----------------------------------------------------|---------------------|---------------------|------------------|--------------|
| 283          | 02/12/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,00                | 1.722,91            | 557,06071000     | 3,0928585890 |
| 276          | 09/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00                | 1.000.000,00        | 368.329,28065300 | 2,7149620000 |
| 277          | 09/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 0,00                | 300.000,00          | 81.830,44956700  | 3,6661170000 |
| 280          | 09/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 1.000.000,00        | 0,00                | 336.062,72274600 | 2,9756350000 |
| 286          | 09/12/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 546.288,27          | 0,00                | 176.135,99577800 | 3,1015140749 |
| 278          | 12/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 294.000,00          | 0,00                | 77.314,32137300  | 3,8026590000 |
| 284          | 12/12/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,00                | 22.826,68           | 7.358,53771700   | 3,1020674050 |
| 289          | 12/12/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,00                | 60.544,88           | 19.517,59007600  | 3,1020674050 |
| 281          | 13/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,00                | 368.280,85          | 123.668,71296300 | 2,9779630000 |
| 279          | 16/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 0,00                | 13.111,99           | 3.465,11747300   | 3,7839950000 |
| 282          | 16/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,00                | 424.436,12          | 142.293,19290284 | 2,9828280000 |
| 285          | 16/12/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 0,00                | 3.313,19            | 1.065,80176500   | 3,1086362480 |
| 288          | 26/12/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 34.372,68           | 0,00                | 11.022,76929700  | 3,1183343380 |
| 287          | 29/12/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           | 1.149.139,91        | 0,00                | 367.883,25342200 | 3,1236537660 |
| <b>Total</b> |            |                                                     | <b>3.023.800,86</b> | <b>2.194.236,62</b> |                  |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 980.726,96

Value-At-Risk: 1,09%

|          | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|----------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| HOLAMBRA |                             | 1,09               | 1,09                |        |       | 89.771.196,59 | 100,00     |

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,11%

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              |                             | 0,02               | 0,00                | 0,02                |        |       | 5.464.774,01  | 6,09       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI           |                             | 0,12               | 0,01                | 0,01                |        |       | 12.936.825,69 | 14,41      |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI                |                             | 2,92               | 0,30                | 0,05                |        |       | 9.500.684,19  | 10,58      |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        |                             | 2,95               | 0,11                | 0,05                |        |       | 3.539.555,77  | 3,94       |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         |                             | 0,11               | 0,00                | 0,01                |        |       | 210.204,87    | 0,23       |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS             |                             | 0,12               | 0,00                | 0,00                |        |       | 2.673.261,83  | 2,98       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      |                             | 1,41               | 0,06                | 0,03                |        |       | 3.871.449,27  | 4,31       |
| BB PREV RF IDKA2                                    |                             | 1,48               | 0,22                | 0,39                |        |       | 14.574.833,46 | 16,24      |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              |                             | 4,80               | 0,10                | 0,11                |        |       | 2.061.474,16  | 2,30       |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI                 |                             | 1,43               | 0,04                | 0,01                |        |       | 2.622.318,37  | 2,92       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP |                             | 1,52               | 0,05                | 0,40                |        |       | 3.095.759,38  | 3,45       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        |                             | 0,62               | 0,01                | 0,64                |        |       | 1.145.118,67  | 1,28       |
| <b>Sub-total</b>                                    | 2,33                        | 1,33               | 0,91                |                     | -0,15  | 0,78  | 61.696.259,67 | 68,73      |

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 |
|------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| LME REC IMA B FI RENDA FIXA              |                             | 0,72               | 0,01                | 2,56                |        |       | 1.562.089,09 | 1,74       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B |                             | 3,06               | 0,02                | 0,24                |        |       | 738.173,66   | 0,82       |
| BB PREV RF IMA-B                         |                             | 2,96               | 0,11                | 0,07                |        |       | 3.438.459,09 | 3,83       |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI       |                             | 0,01               | 0,00                | 0,01                |        |       | 8.590.160,74 | 9,57       |

### 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 |
|----------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5              |                             | 1,43               | 0,01                | 0,05                |        |       | 542.568,06    | 0,60       |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA         |                             | 1,63               | 0,02                | 1,64                |        |       | 1.111.553,75  | 1,24       |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA |                             | 0,01               | -0,00               | 0,01                |        |       | 3.165.020,35  | 3,53       |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM       |                             | 0,01               | 0,00                | 0,01                |        |       | 5.833.715,08  | 6,50       |
| <b>Sub-total</b>                             | 1,11                        | 0,63               | 0,17                |                     | -0,27  | 0,82  | 24.981.739,82 | 27,83      |

Artigo 7º V, Alínea a

| Ativo                         | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)   | % Carteira |
|-------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC |                             | 0,02               | 0,00                | 0,02                |        |       | 1.110.171,71 | 1,24       |
| <b>Sub-total</b>              | 0,63                        | 0,02               | 0,00                |                     | -1,48  | 0,19  | 1.110.171,71 | 1,24       |

#### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,54%

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 |
|----------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| BB PREV MULTIMERCADO FI LP |                             | 0,54               | 0,01                | 0,54                |        |       | 1.983.025,39 | 2,21       |
| <b>Sub-total</b>           | 1,18                        | 0,54               | 0,01                |                     | -0,06  | 1,05  | 1.983.025,39 | 2,21       |