



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
SETEMBRO 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 30.09.2022.

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 81,75%

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 150824 | 3,21 | 0,50 | 6,33 | 36.160.075,96 | 5,29 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 | 9,60 | 2,89 | 5,46 | 15.475.663,06 | 2,27 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,170000%) | 0,66 | 0,07 | 8,67 | 21.024.287,85 | 3,08 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,660001%) | 2,83 | 0,11 | 7,43 | 20.890.244,00 | 3,06 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,859998%) | 2,90 | 0,13 | 6,21 | 20.641.416,38 | 3,02 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,020001%) | 0,66 | 0,06 | 8,56 | 49.214.936,15 | 7,21 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 2,05 | 0,44 | 7,67 | 163.406.623,40 | 23,93 |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,73 | 1,09 | 8,39 | 72.778.016,22 | 10,66 | 6.071.749.354,31 | 1,20 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 5,46 | 1,45 | 5,92 | 75.540.039,80 | 11,06 | 5.858.339.074,80 | 1,29 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,92 | 0,51 | 6,53 | 68.388.890,12 | 10,01 | 8.482.726.221,67 | 0,81 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,84 | 1,53 | 8,40 | 53.436.136,02 | 7,82 | 2.451.788.610,47 | 2,18 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 2,54 | 1,24 | 6,69 | 51.513.709,54 | 7,54 | 4.594.008.809,74 | 1,12 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,69 | 1,24 | 8,29 | 66.164.644,86 | 9,69 | 5.850.800.339,33 | 1,13 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 2,41 | 1,17 | 7,36 | 387.821.436,56 | 56,78 | | |

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|---------------|---------|
| GRAPHEN | RJI | LME REC IMA B FI RENDA FIXA | 1,80 | 0,96 | 4,78 | 3.766.049,98 | 0,55 | 71.358.022,82 | 5,28 |
| QUELUZ | RJI | BRA1 FI RENDA FIXA | 1,70 | 0,13 | 3,93 | 274.127,99 | 0,04 | 6.572.550,67 | 4,17 |
| VERITAS | RJI | FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | 25,35 | 0,01 | 3,91 | 518.107,43 | 0,08 | 78.992.263,67 | 0,66 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 3,56 | 0,79 | 4,44 | 4.558.285,40 | 0,67 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|---------|-------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|---------------|---------|
| GRAPHEN | RJI | LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | 1,37 | 0,26 | 2,95 | 1.874.564,55 | 0,27 | 74.215.736,30 | 2,53 |
| PETRA | FINAXIS | FIDC PREMIUM | 88,33 | -0,46 | -59,72 | 671.817,31 | 0,10 | 30.976.188,91 | 2,17 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | | | 37,21 | 0,07 | -27,01 | 2.546.381,86 | 0,37 | | |
| Renda Fixa | | | 2,18 | 0,94 | 7,17 | 558.332.727,22 | 81,75 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

13,64%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRAM | BEM | BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 25,11 | -1,34 | -2,76 | 23.297.100,31 | 3,41 | 1.002.602.097,35 | 2,32 |
| AZ QUEST | BEM | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 17,31 | -2,18 | -5,30 | 43.435.609,93 | 6,36 | 1.083.847.526,25 | 4,01 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 18,75 | -1,00 | 2,10 | 26.419.564,13 | 3,87 | 1.961.836.267,82 | 1,35 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 19,10 | -1,64 | -2,66 | 93.152.274,37 | 13,64 | | |
| Renda Variável | | | 18,54 | -1,64 | -2,66 | 93.152.274,37 | 13,64 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,86%

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 |
|----------------------------------|-------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| XP | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 36,27 | -9,46 | -46,23 | 7.594.915,39 | 1,11 | 551.200.355,41 | 1,38 |
| SCHRODER | BEM | SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE | 21,92 | -6,57 | -29,50 | 18.753.748,71 | 2,75 | 263.717.596,44 | 7,11 |
| Sub-total Artigo 9º II | | | 24,53 | -7,42 | -35,31 | 26.348.664,10 | 3,86 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 24,53 | -7,42 | -35,31 | 26.348.664,10 | 3,86 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,24%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------|----------------|---------|
| VERITAS | RJI | CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -88.757,47 | -0,01 | -13.532.239,17 | |
| GRAPHEN | RJI | LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | 0,74 | -0,34 | -4,17 | 210.059,28 | 0,03 | 1.487.640,13 | 14,12 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 209,49 | -0,59 | -84,49 | 121.301,81 | 0,02 | | |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------------|------------|---------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|---------------|---------|
| QUELUZ | BNY MELLON | BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | 0,26 | -0,04 | -0,48 | 1.503.736,34 | 0,22 | 27.748.203,59 | 5,42 |
| GENIAL | RJI | GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA | 0,78 | 0,00 | -100,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| VALORA | BEM | FIP BRASIL ÓLEO & GÁS | 240,63 | -2,92 | -12.170,89 | 424,72 | 0,00 | 106.181,14 | 0,40 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 34,25 | -0,04 | -25,93 | 1.504.161,06 | 0,22 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 32,95 | -0,08 | -31,68 | 1.625.462,87 | 0,24 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,52%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------|-------------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|---------------|------------------|---------|
| RIO BRAVO | RIO BRAVO | FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII | 16,75 | -0,90 | 3,59 | 1.941.400,00 | 0,28 | 1.192.129.251,94 | 0,16 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BRCR11 | 30,60 | -0,20 | 2,44 | 226.538,34 | 0,03 | 2.680.102.805,30 | 0,01 |
| QUELUZ | RJI | ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | 16,64 | -0,18 | 14,63 | 1.358.216,14 | 0,20 | 145.423.003,98 | 0,93 |
| Sub-total Artigo 11º | | | 11,86 | -0,58 | 7,30 | 3.526.154,48 | 0,52 | | |
| Fundos Imobiliários | | | 11,86 | -0,58 | 7,30 | 3.526.154,48 | 0,52 | | |
| Total | | | 3,76 | 0,23 | 2,97 | 682.985.283,04 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | Pró-Gestão Nível 1 | |
|-----------------------------------|---|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 163.406.623,40 | 23,93 | 0,00 | 27,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 387.821.436,56 | 56,78 | 0,00 | 35,50 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 4.558.285,40 | 0,67 | 0,00 | 1,00 | 65,00 | 0,00 | 65,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 2.546.381,86 | 0,37 | 0,00 | 0,50 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 558.332.727,22 | 81,75 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 93.152.274,37 | 13,64 | 0,00 | 18,00 | 35,00 | 0,00 | 35,00 |
| | Total Renda Variável | 93.152.274,37 | 13,64 | | | | | 35,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º II | Fundos de Investimento no Exterior | 26.348.664,10 | 3,86 | 0,00 | 8,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 26.348.664,10 | 3,86 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 121.301,81 | 0,02 | 0,00 | 8,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 1.504.161,06 | 0,22 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 1.625.462,87 | 0,24 | | | | | 15,00 |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 3.526.154,48 | 0,52 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Fundos Imobiliários | 3.526.154,48 | 0,52 | | | | | 5,00 |
| Total | | 682.985.283,04 | 100,00 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|---------------------|---------------------|-------------------|---------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 0,44 40,67 | 7,67 86,30 | 0,67 20,16 | 4,03 63,80 | 10,54 96,73 | 709.289,76 | 11.458.973,05 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,17 108,75 | 7,36 82,77 | 2,36 71,28 | 4,55 72,15 | 8,73 80,09 | 4.480.017,46 | 26.205.979,57 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 0,79 74,01 | 4,44 49,93 | 3,33 100,58 | 4,99 79,07 | | 36.170,96 | 196.631,15 |
| Artigo 7º V, Alínea a % do CDI | 0,07 6,68 | -27,01 -303,79 | -0,22 -6,69 | -27,50 -435,54 | | 1.822,18 | -942.235,33 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | -1,64 -2,11 | -2,66 -7,64 | 9,74 -1,93 | -9,45 -1,14 | | -1.552.483,99 | -2.550.157,35 |
| Artigo 9º II % do CDI | -7,42 -692,59 | -35,31 -397,11 | -1,72 -51,99 | -14,51 -229,84 | -32,39 -297,28 | -2.113.137,62 | -14.379.097,49 |
| Artigo 10º I % do CDI | -0,59 -55,03 | -84,49 -950,37 | -83,98 -2.537,09 | -84,18 -1.333,51 | | -719,80 | -186.664,89 |
| Artigo 10º II % do CDI | -0,04 -4,01 | -25,93 -291,63 | 0,10 3,13 | -25,64 -406,18 | | -647,57 | -528.947,55 |
| Artigo 11º % do CDI | -0,58 -54,11 | 7,30 82,13 | 6,41 193,58 | 8,96 141,86 | | -20.685,66 | 242.360,48 |
| HORTOLÂNDIA (Total) | | | | | | 1.539.625,72 | 19.516.841,64 |

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 150535 (5,170000%) | 21.009.177,14 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.024.287,85 | 15.110,71 | 1.713.110,34 |
| NTN-B 150545 | 15.041.037,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.475.663,06 | 434.626,05 | 815.770,83 |
| NTN-B 150545 (5,660001%) | 20.867.139,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.890.244,00 | 23.104,34 | 1.473.324,96 |
| NTN-B 150545 (5,859998%) | 20.615.367,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.641.416,38 | 26.049,09 | 1.228.702,48 |
| NTN-B 150824 | 35.979.225,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 36.160.075,96 | 180.850,85 | 2.228.357,59 |
| NTN-B 150840 (5,020001%) | 49.185.387,43 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 49.214.936,15 | 29.548,72 | 3.999.706,85 |
| | | | | | 163.406.623,40 | 0,00 | 0,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 50.883.845,97 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 51.513.709,54 | 629.863,57 | 3.231.365,18 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 74.460.034,93 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 75.540.039,80 | 1.080.004,87 | 4.220.708,72 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 69.592.695,89 | 7.260.000,00 | -4.880.000,00 | 0,00 | 72.778.016,22 | 805.320,33 | 5.105.652,52 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 68.041.843,85 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 68.388.890,12 | 347.046,27 | 4.441.255,14 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 65.353.282,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 66.164.644,86 | 811.362,15 | 5.064.928,97 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 52.629.715,75 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 53.436.136,02 | 806.420,27 | 4.142.069,04 |
| | | | | | 387.821.436,56 | 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\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRA1 FI RENDA FIXA | 319.617,01 | 0,00 | 0,00 | 45.878,80 | 274.127,99 | 389,78 | 14.536,12 |
| FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | 518.065,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 518.107,43 | 42,38 | 10.222,62 |
| LME REC IMA B FI RENDA FIXA | 3.730.311,18 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.766.049,98 | 35.738,80 | 171.872,41 |
| | | | | | 4.558.285,40 | 0,00 | 0,00 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIDC PREMIUM | 674.902,24 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 671.817,31 | -3.084,93 | -995.867,84 |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | 1.869.657,44 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.874.564,55 | 4.907,11 | 53.632,51 |
| | | | | | 2.546.381,86 | 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 | 44.405.632,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 43.435.609,93 | -970.022,16 | -2.431.886,91 |
| BRANDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 23.612.495,46 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 23.297.100,31 | -315.395,15 | -661.803,52 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 26.686.630,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 26.419.564,13 | -267.066,68 | 543.533,08 |
| | | | | | 93.152.274,37 | 0,00 | 0,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 8.388.502,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.594.915,39 | -793.586,81 | -6.530.654,25 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE | 20.073.299,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 18.753.748,71 | -1.319.550,81 | -7.848.443,24 |
| | | | | | 26.348.664,10 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|
| CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO | -88.757,47 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -88.757,47 | 0,00 | 0,00 |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | 210.779,08 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 210.059,28 | -719,80 | -9.149,95 |
| | | | | | 121.301,81 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | 1.504.371,12 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.503.736,34 | -634,78 | -7.289,69 |
| FIP BRASIL ÓLEO & GÁS | 437,51 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 424,72 | -12,79 | 7.703,79 |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -529.361,65 |
| | | | | | 1.504.161,06 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|-----------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRCR11 | 228.518,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.525,62 | 226.538,34 | -454,44 | 4.804,08 |
| FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII | 1.979.600,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.400,00 | 1.941.400,00 | -17.800,00 | 64.200,00 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | 1.360.647,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.358.216,14 | -2.431,22 | 173.356,40 |
| | | | | | | 3.526.154,48 | 0,00 | 0,00 |

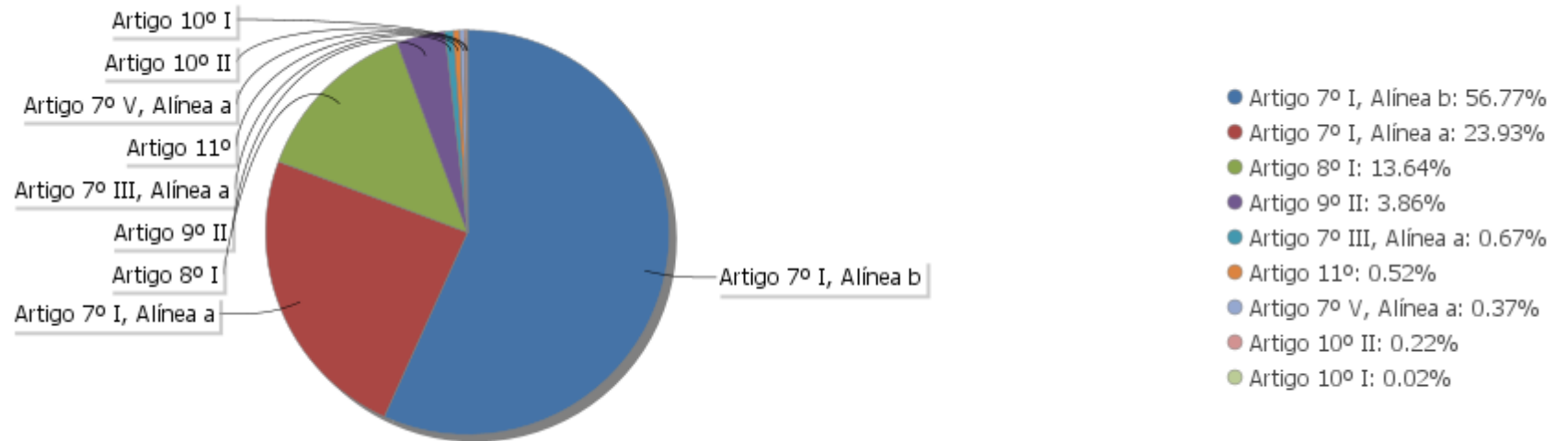
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

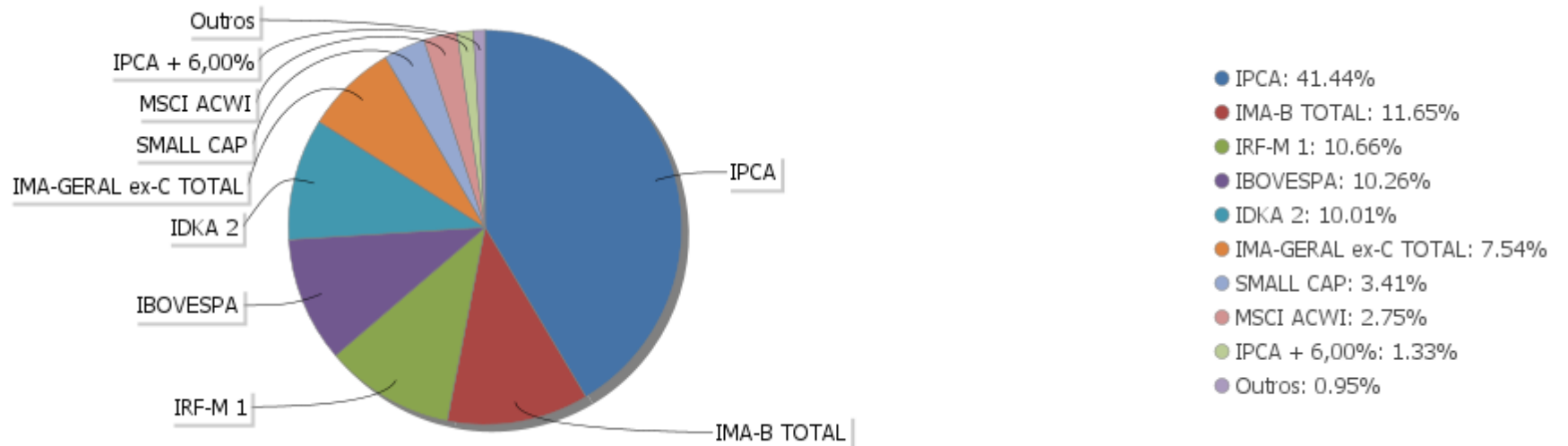
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 485.301.193,97 | 71,06 | 485.301.193,97 | 71,06 |
| de 31 a 365 dias | 26.419.564,13 | 3,87 | 511.720.758,10 | 74,92 |
| acima de 365 dias | 171.264.524,94 | 25,08 | 682.985.283,04 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

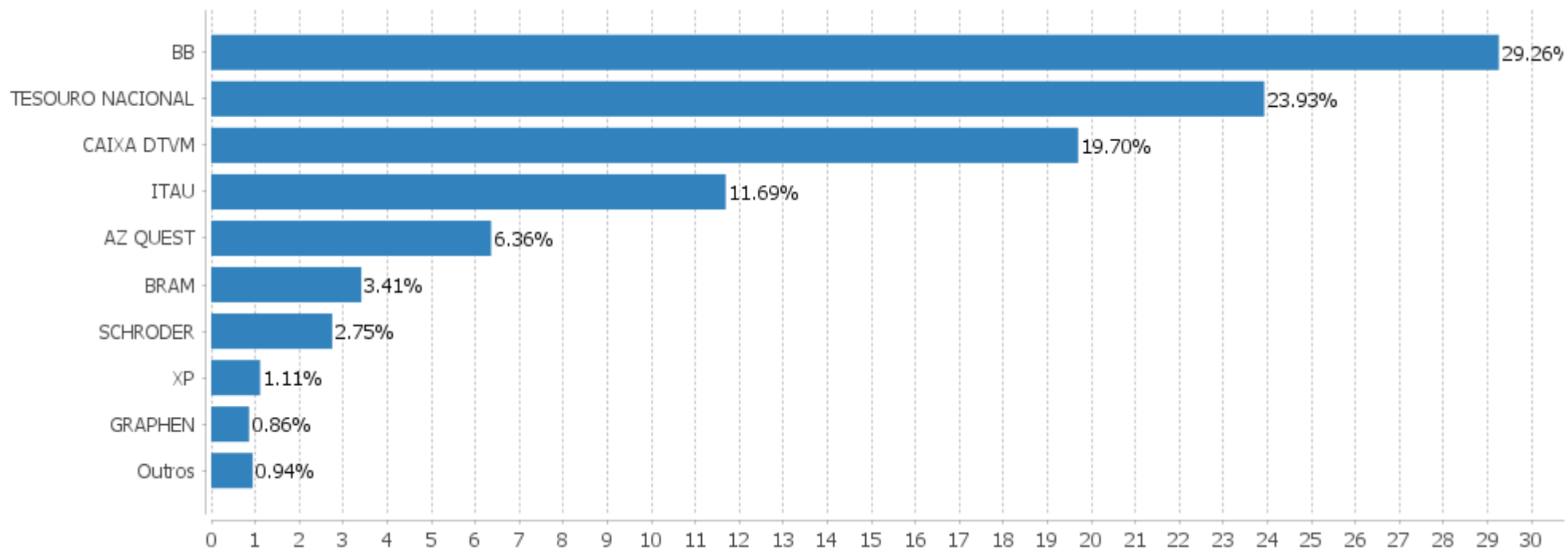


Alocação Por Estratégia



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 | -0,33 | 0,06 | 2,07 | -0,52 | 0,46 | -1,47 | 1,14 | 1,34 | 0,23 | | | | 2,97 |
| IPCA + 4,84% | 0,94 | 1,37 | 2,04 | 1,42 | 0,89 | 1,07 | -0,29 | 0,07 | 0,10 | | | | 7,85 |
| p.p. indexador | -1,26 | -1,31 | 0,03 | -1,94 | -0,43 | -2,54 | 1,42 | 1,27 | 0,13 | | | | -4,87 |
| 2021 | -0,37 | -0,60 | 0,51 | 1,09 | 1,28 | 0,17 | -0,77 | -1,12 | -0,53 | -1,71 | 0,97 | 0,80 | -0,33 |
| IPCA + 5,41% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,27 | 0,97 | 1,43 | 1,34 | 1,61 | 1,67 | 1,37 | 1,22 | 15,99 |
| p.p. indexador | -1,04 | -1,84 | -0,90 | 0,36 | 0,01 | -0,80 | -2,19 | -2,46 | -2,14 | -3,38 | -0,40 | -0,42 | -16,32 |
| 2020 | 0,74 | -0,95 | -6,76 | 0,85 | 2,01 | 1,95 | 2,67 | -0,62 | -1,01 | 0,15 | 2,81 | 2,88 | 4,40 |
| IPCA + 5,87% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,88 | 0,72 | 1,12 | 1,34 | 1,35 | 1,86 | 10,63 |
| p.p. indexador | 0,03 | -1,61 | -7,33 | 0,71 | 1,94 | 1,21 | 1,79 | -1,34 | -2,13 | -1,19 | 1,46 | 1,02 | -6,22 |
| 2019 | 2,83 | 0,10 | 0,40 | 1,16 | 1,59 | 2,44 | 1,21 | 0,05 | 1,70 | 1,87 | -0,25 | 2,19 | 16,35 |
| 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 | 2,00 | -0,79 | -0,79 | 0,10 | 0,95 | 1,99 | 0,49 | -0,57 | 1,25 | 1,24 | -1,23 | 0,55 | 5,76 |

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

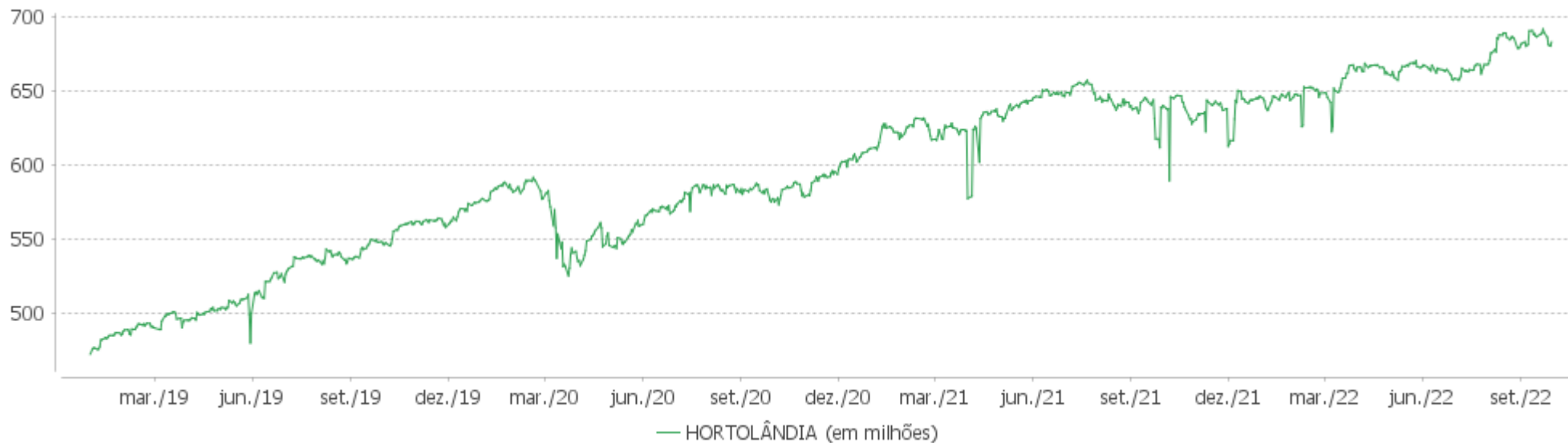
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 21 | 46,67 | 03 meses | 2,73 | -0,11 | 2,84 | 3,75 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 24 | 53,33 | 06 meses | 1,14 | 3,29 | -2,15 | 3,57 |
| | | | 12 meses | 3,01 | 12,51 | -9,50 | 3,76 |
| | | | 24 meses | 8,72 | 30,86 | -22,14 | 4,04 |
| | | | 36 meses | 11,27 | 42,93 | -31,66 | 6,57 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,88 | 2020-12 | Desde 31/12/2018 | 24,67 | 53,04 | -28,37 | 6,10 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,76 | 2020-03 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

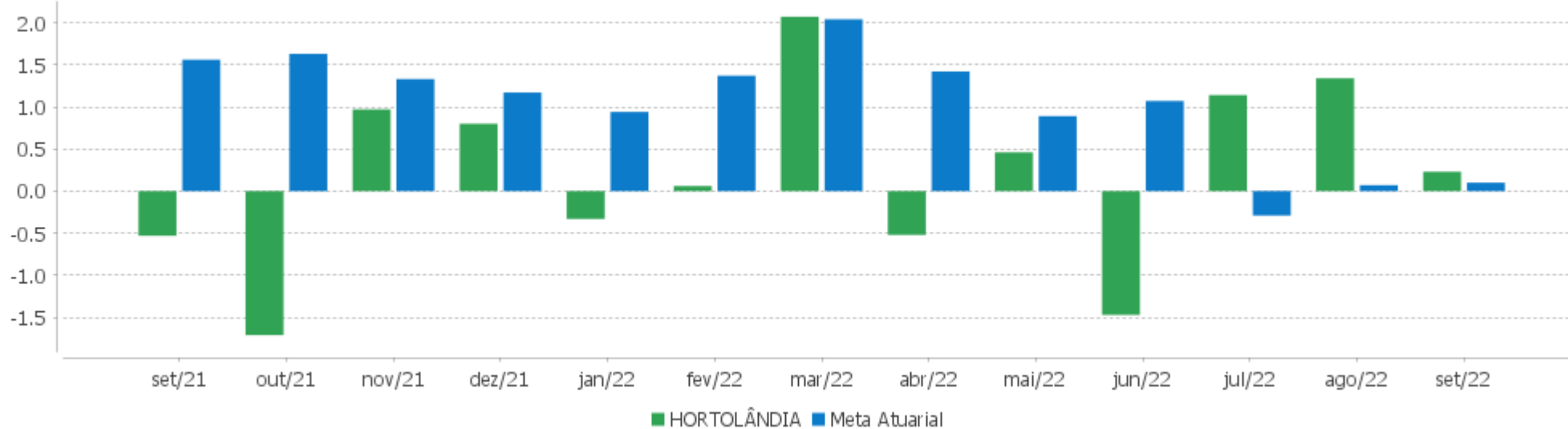


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| NTN-B 150824 Var. IPCA p.p. | 0,50 0,79 | 6,33 2,24 | 0,04 1,36 | 2,47 1,60 | 8,56 1,39 | 14,12 -4,03 | 23,15 1,30 |
| NTN-B 150545 Var. IPCA p.p. | 2,89 3,18 | 5,46 1,37 | 3,87 5,20 | 3,38 2,52 | 3,94 -3,23 | 8,21 -9,94 | 4,44 -17,41 |
| NTN-B 150545 (5,660001%) Var. IPCA p.p. | 0,11 0,40 | 9,05 4,96 | 0,53 1,86 | 4,81 3,95 | 10,82 3,65 | 21,91 3,76 | 25,11 3,25 |
| NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IPCA p.p. | 0,06 0,35 | 8,56 4,47 | 0,37 1,70 | 4,49 3,63 | 13,27 6,10 | 24,29 6,14 | 27,25 5,40 |
| NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IPCA p.p. | 0,07 0,36 | 8,67 4,58 | 0,41 1,74 | 4,57 3,70 | 13,43 6,26 | 24,43 6,28 | 27,36 5,50 |
| NTN-B 150545 (5,859998%) Var. IPCA p.p. | 0,13 0,42 | 9,21 5,12 | 0,58 1,91 | 4,91 4,05 | 10,96 3,79 | 22,11 3,96 | 25,37 3,52 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 1,24 | 6,69 | 2,87 | 4,60 | 7,75 | 9,64 | 13,70 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | 1,24 1,53 | 8,29 4,20 | 3,54 4,86 | 5,84 4,98 | 9,44 2,28 | 10,38 -7,77 | 17,45 -4,40 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 1,09 -0,03 | 8,39 -0,21 | 3,37 -0,06 | 6,02 -0,16 | 9,57 -0,24 | 11,94 -0,61 | 16,61 -1,05 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,51 -0,11 | 6,53 -0,41 | 0,11 0,02 | 2,60 -0,34 | 8,47 -0,45 | 14,89 -0,79 | 23,34 -1,60 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,45 -0,03 | 5,92 -0,20 | 1,63 -0,07 | 3,07 -0,09 | 6,95 -0,30 | 11,76 -0,54 | 13,80 -0,87 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p. | 1,53 1,82 | 8,40 4,31 | 2,97 4,30 | 5,62 4,76 | 10,74 3,57 | 13,75 -4,40 | 17,95 -3,91 |
| FIDC PREMIUM % do CDI | -0,46 -42,64 | -59,72 -671,68 | -1,52 -45,84 | -59,64 -944,66 | -60,12 -551,80 | -62,24 -437,90 | -64,09 -350,67 |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI | 0,26 24,48 | 2,95 33,13 | 0,25 7,60 | 1,46 23,11 | 3,77 34,59 | 3,21 22,60 | -3,52 -19,26 |
| BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,13 -1,35 | 3,93 -2,19 | 0,07 -1,63 | 1,91 -1,25 | 4,32 -2,93 | 2,87 -9,43 | -42,50 -57,16 |
| LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,96 -0,52 | 4,78 -1,34 | 1,46 -0,24 | 2,83 -0,32 | 2,42 -4,82 | 1,86 -10,44 | -0,94 -15,60 |
| FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | 0,01 | 2,07 | 18,40 | 22,51 | 2,21 | -37,10 | -38,03 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|------------------|---------------------|---------------------|---------------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| Var. IMA-B 5 p.p. | -0,41 | -5,01 | 17,96 | 19,37 | -7,03 | -52,85 | -62,16 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p. | -2,18 -2,65 | -5,30 -10,28 | 7,57 -4,09 | -10,89 -2,59 | -13,12 -12,27 | 0,05 -16,27 | -0,91 -5,96 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p. | -1,00 -1,47 | 2,10 -2,87 | 11,81 0,14 | -3,37 4,93 | -6,05 -5,21 | 12,04 -4,27 | 0,24 -4,81 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p. | -1,34 0,50 | -2,76 5,30 | 11,58 -2,90 | -13,01 0,81 | -14,44 3,99 | 0,72 6,30 | -0,96 6,31 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p. | -6,57 -0,80 | -29,50 -0,53 | -3,00 1,29 | -11,56 -0,31 | -24,72 -2,25 | -2,41 3,74 | |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p. | -9,46 -9,66 | -46,23 -54,97 | 1,59 1,42 | -21,02 -24,88 | -45,36 -58,96 | -40,77 -73,50 | |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI | -0,34 -31,86 | -4,17 -46,95 | -1,03 -31,09 | -2,26 -35,83 | -5,41 -49,61 | -9,86 -69,39 | -7,72 -42,26 |
| CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO Var. IMA-B 5 p.p. | 0,00 -0,42 | 0,00 -0,80 | | | | | |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p. | 0,00 -0,20 | -0,99 -9,73 | 0,00 -0,17 | 0,00 -3,87 | -1,90 -15,50 | 132,54 99,82 | -92,80 -137,90 |
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p. | -0,04 -0,24 | -0,48 -9,22 | -0,20 -0,37 | -0,32 -4,18 | -0,82 -14,42 | -2,24 -34,96 | 29,75 -15,34 |
| FIP BRASIL ÓLEO & GÁS % do CDI | -2,92 -272,75 | 900,85 10.132,65 | 934,33 28.225,38 | 900,85 14.269,82 | 900,85 8.267,71 | -29,14 -205,00 | 133,78 732,02 |
| BRCR11 Var. IBOVESPA p.p. | -0,20 -0,67 | 2,44 -2,54 | 15,23 3,56 | 8,02 16,33 | 3,03 3,88 | -10,73 -27,04 | -5,91 -10,96 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p. | -0,18 -0,67 | 14,63 8,00 | -0,52 -7,50 | 18,73 11,15 | 14,51 4,38 | -32,63 -39,64 | -31,75 -43,17 |
| FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI | -0,90 -83,88 | 3,59 40,37 | 10,70 323,27 | 3,52 55,69 | 0,38 3,53 | -0,74 -5,23 | 1,06 5,81 |
| HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 4,84% p.p. | 0,23 0,13 | 2,97 -4,87 | 2,73 2,84 | 1,14 -2,15 | 3,01 -9,35 | 8,72 -21,12 | 11,27 -29,12 |
| CDI | 1,07 | 8,89 | 3,31 | 6,31 | 10,90 | 14,21 | 18,28 |
| IBOVESPA | 0,47 | 4,97 | 11,66 | -8,30 | -0,85 | 16,31 | 5,05 |
| INPC + 6,00% | 0,17 | 8,98 | 0,27 | 3,88 | 13,62 | 33,40 | 46,90 |
| IPCA + 6,00% | 0,20 | 8,74 | 0,17 | 3,87 | 13,60 | 32,72 | 45,10 |

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 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | D+0 | D+0 | D+3 du | D+3 du | | 0,30 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS 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 |
| BRA1 FI RENDA FIXA | D+0 | D+0 | D+1440 | D+1445 | | 1,30 |
| BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| BRCR11 | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO | | | | | | |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | D+0 | D+0 | D+30 ou D+1800 (isento de taxa de resgate) | D+31 ou D+1801 (isento de taxa de resgate) | | 0,00 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,40 |
| FIDC PREMIUM | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| FIP BRASIL ÓLEO & GÁS | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | D+0 | D+0 | D+21 du | D+23 du | O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO | 1,90 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---------------|---------------|-----------|------------|---|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| | | | | | IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA | |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,40 |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,00 |
| 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 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+5 du | | 0,80 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+4 du | - | |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | Não se aplica | Não se aplica | | | | |

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 | 1,11 | 8,59 | 3,43 | 6,17 | 9,81 | 12,55 | 17,67 | 26,42 | 34,96 |
| IRF-M 1+ | 1,58 | 6,25 | 5,47 | 5,41 | 7,24 | 3,87 | 11,78 | 35,04 | 42,24 |
| IRF-M TOTAL | 1,40 | 6,96 | 4,66 | 5,53 | 8,01 | 6,91 | 13,92 | 33,10 | 40,74 |
| IMA-B 5 | 0,42 | 7,07 | 0,43 | 3,14 | 9,25 | 15,75 | 24,13 | 43,24 | 52,60 |
| IMA-B 5+ | 2,39 | 5,10 | 3,01 | 3,14 | 5,19 | 8,56 | 6,75 | 54,62 | 53,36 |
| IMA-B TOTAL | 1,48 | 6,12 | 1,70 | 3,16 | 7,25 | 12,30 | 14,67 | 50,64 | 54,48 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,26 | 7,80 | 3,17 | 5,13 | 9,24 | 11,95 | 16,81 | 36,41 | 43,76 |
| IDKA 2 | 0,62 | 6,94 | 0,09 | 2,94 | 8,91 | 15,68 | 24,94 | 40,99 | 52,99 |
| IDKA 20 | 5,00 | 3,97 | 6,75 | 3,59 | 0,98 | 3,03 | -6,12 | 61,55 | 50,87 |
| CDI | 1,07 | 8,89 | 3,31 | 6,31 | 10,90 | 14,21 | 18,28 | 25,70 | 34,07 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 0,47 | 4,97 | 11,66 | -8,30 | -0,85 | 16,31 | 5,05 | 38,69 | 48,11 |
| IBRX 100 | -0,05 | 4,43 | 10,77 | -9,10 | -1,33 | 16,26 | 6,28 | 43,30 | 51,68 |
| IBRX 50 | 0,48 | 5,31 | 11,70 | -8,80 | 0,58 | 19,15 | 7,21 | 38,32 | 48,42 |
| SMALL CAP | -1,84 | -8,06 | 14,47 | -13,82 | -18,43 | -5,58 | -7,27 | 45,86 | 34,71 |
| IFIX | 0,49 | 6,63 | 6,98 | 7,58 | 10,13 | 7,01 | 11,42 | 40,10 | 34,66 |
| Índice Consumo - ICON | -1,18 | | 15,08 | -17,92 | -27,77 | -28,97 | -29,71 | 8,70 | -9,15 |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,80 | 9,21 | 4,42 | -5,43 | 7,21 | 28,20 | 15,63 | 76,72 | 67,29 |

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 | -0,29 | 4,09 | -1,32 | 0,86 | 7,17 | 18,15 | 21,85 | 25,38 | 31,05 |
| INPC | -0,32 | 4,32 | -1,23 | 0,87 | 7,19 | 18,75 | 23,37 | 26,97 | 32,02 |
| IGPM | -0,95 | 6,61 | -1,43 | 1,07 | 8,25 | 35,16 | 59,40 | 64,77 | 81,31 |
| SELIC | 1,07 | 8,89 | 3,31 | 6,31 | 10,90 | 14,21 | 18,28 | 25,70 | 34,08 |

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 | -5,36 | -27,11 | -2,23 | -9,68 | -17,26 | 2,19 | 56,39 | 66,16 | 142,89 |
| MSCI ACWI | -5,78 | -28,97 | -4,29 | -11,25 | -22,48 | -6,15 | 37,99 | 42,53 | 93,97 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,04 | 7,20 | -0,32 | 2,87 | 11,46 | 27,77 | 37,05 | 46,63 | 59,32 |
| IPCA + 5,00% | 0,12 | 7,97 | -0,07 | 3,37 | 12,53 | 30,23 | 41,03 | 52,34 | 67,10 |
| IPCA + 5,50% | 0,16 | 8,35 | 0,05 | 3,62 | 13,06 | 31,48 | 43,06 | 55,26 | 71,10 |
| IPCA + 5,89% | 0,19 | 8,65 | 0,14 | 3,81 | 13,48 | 32,45 | 44,65 | 57,56 | 74,27 |
| IPCA + 6,00% | 0,20 | 8,74 | 0,17 | 3,87 | 13,60 | 32,72 | 45,10 | 58,22 | 75,18 |
| INPC + 4,00% | 0,01 | 7,43 | -0,22 | 2,89 | 11,48 | 28,42 | 38,75 | 48,49 | 60,50 |
| INPC + 6,00% | 0,17 | 8,98 | 0,27 | 3,88 | 13,62 | 33,40 | 46,90 | 60,23 | 76,47 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|---------------------|---------------------|--------------------|--------------|
| 77 | 01/09/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 70.000,00 | 0,00 | 23.324,86172800 | 3,0010896020 |
| 74 | 01/09/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,00 | 30.000,00 | 9.996,36931200 | 3,0010896020 |
| 78 | 08/09/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 170.000,00 | 0,00 | 56.550,10133700 | 3,0061838260 |
| 79 | 09/09/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 6.620.000,00 | 0,00 | 2.200.666,18134400 | 3,0081800030 |
| 76 | 09/09/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 400.000,00 | 0,00 | 132.970,76624400 | 3,0081800030 |
| 80 | 27/09/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,00 | 4.700.000,00 | 1.552.532,70852700 | 3,0273114210 |
| 75 | 27/09/2022 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,00 | 150.000,00 | 49.548,91623000 | 3,0273114210 |
| Total | | | 7.260.000,00 | 4.880.000,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.367.418,63

Value-At-Risk: 1,81%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| HORTOLÂNDIA | | 1,81 | 1,81 | | | 682.985.283,04 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,02%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| NTN-B 150824 | | 1,60 | 0,06 | 1,60 | | | 36.160.075,96 | 5,29 |
| NTN-B 150545 | | 4,86 | 0,08 | 4,86 | | | 15.475.663,06 | 2,27 |
| NTN-B 150535 (5,170000%) | | 0,19 | -0,00 | 0,17 | | | 21.024.287,85 | 3,08 |
| NTN-B 150545 (5,660001%) | | 0,19 | -0,00 | 0,17 | | | 20.890.244,00 | 3,06 |
| NTN-B 150545 (5,859998%) | | 0,19 | -0,00 | 0,17 | | | 20.641.416,38 | 3,02 |
| NTN-B 150840 (5,020001%) | | 0,19 | -0,00 | 0,17 | | | 49.214.936,15 | 7,21 |
| Sub-total | 1,37 | 0,75 | 0,13 | | -0,46 | 0,44 | 163.406.623,40 | 23,93 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | | 0,18 | 0,01 | 0,01 | | | 72.778.016,22 | 10,66 |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI | | 2,44 | 0,19 | 0,05 | | | 75.540.039,80 | 11,06 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,54 | 0,10 | 0,42 | | | 68.388.890,12 | 10,01 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | | 1,42 | 0,06 | 1,43 | | | 53.436.136,02 | 7,82 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | | 1,01 | 0,06 | 1,01 | | | 51.513.709,54 | 7,54 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | | 1,25 | 0,07 | 1,27 | | | 66.164.644,86 | 9,69 |
| Sub-total | 2,65 | 1,17 | 0,49 | | 0,04 | 1,17 | 387.821.436,56 | 56,78 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
|-------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| LME REC IMA B FI RENDA FIXA | | 0,54 | 0,00 | 2,24 | | | 3.766.049,98 | 0,55 |
| BRA1 FI RENDA FIXA | | 0,65 | 0,00 | 2,38 | | | 274.127,99 | 0,04 |
| FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | | 2,06 | 0,00 | 2,30 | | | 518.107,43 | 0,08 |
| Sub-total | 1,09 | 0,51 | 0,00 | | -0,26 | 0,79 | 4.558.285,40 | 0,67 |

Artigo 7º V, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | | 0,04 | 0,00 | 0,04 | | | 1.874.564,55 | 0,27 |
| FIDC PREMIUM | | 4,15 | -0,00 | 4,14 | | | 671.817,31 | 0,10 |
| Sub-total | 0,25 | 1,08 | -0,00 | | -4,03 | 0,07 | 2.546.381,86 | 0,37 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,25%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | | 12,40 | 0,38 | 3,35 | | | 23.297.100,31 | 3,41 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | | 8,43 | 0,47 | 5,15 | | | 43.435.609,93 | 6,36 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | | 8,65 | 0,28 | 4,41 | | | 26.419.564,13 | 3,87 |
| Sub-total | 21,98 | 9,25 | 1,13 | | -0,12 | -1,64 | 93.152.274,37 | 13,64 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,83%

Artigo 9º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | | 20,12 | 0,05 | 20,13 | | | 7.594.915,39 | 1,11 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE | | 11,01 | 0,01 | 11,68 | | | 18.753.748,71 | 2,75 |
| Sub-total | 22,53 | 12,83 | 0,06 | | -0,38 | -7,42 | 26.348.664,10 | 3,86 |

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,08%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII | | 0,14 | 0,00 | 0,14 | | | 1.941.400,00 | 0,28 |
| BRCR11 | | 0,17 | 0,00 | 10,31 | | | 226.538,34 | 0,03 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | | 0,05 | -0,00 | 2,32 | | | 1.358.216,14 | 0,20 |
| Sub-total | 1,78 | 0,08 | -0,00 | | -0,93 | -0,58 | 3.526.154,48 | 0,52 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,01%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-----------|-------|------------|------------|
| CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO | | -0,00 | 0,00 | -1,17 | | | -88.757,47 | -0,01 |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | | 0,01 | -0,00 | 0,01 | | | 210.059,28 | 0,03 |
| Sub-total | 0,00 | 0,02 | -0,00 | | -1.866,71 | -0,59 | 121.301,81 | 0,02 |

Artigo 10º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | | 0,01 | -0,00 | 0,16 | | | 1.503.736,34 | 0,22 |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA | | NaN | 0,00 | NaN | | | 0,00 | 0,00 |
| FIP BRASIL ÓLEO & GÁS | | 10,57 | -0,00 | 10,57 | | | 424,72 | 0,00 |
| Sub-total | 0,15 | 0,01 | -0,00 | | -7,48 | -0,04 | 1.504.161,06 | 0,22 |