



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
JULHO 2021



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 30.07.2021.

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 76,37%

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 | 3,96 | -0,16 | 0,09 | 35.944.175,92 | 5,58 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 | 9,35 | -0,57 | -2,19 | 16.409.511,00 | 2,55 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 3,75 | -0,29 | 4,43 | 52.353.686,92 | 8,13 |

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 | 0,37 | 0,16 | 0,82 | 91.024.826,54 | 14,14 | 6.744.375.720,34 | 1,35 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 5,65 | -0,38 | -1,20 | 71.548.298,76 | 11,11 | 7.757.107.360,64 | 0,92 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,50 | -0,06 | 1,50 | 97.489.987,44 | 15,14 | 12.042.628.715,86 | 0,81 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,00 | -0,47 | -2,15 | 13.617.687,78 | 2,12 | 1.581.480.875,05 | 0,86 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 2,93 | -0,25 | -0,93 | 48.025.128,70 | 7,46 | 8.970.903.955,40 | 0,54 |
| CEF | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2,49 | -0,78 | -0,06 | 61.127.302,75 | 9,49 | 15.935.689.880,46 | 0,38 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | 2,67 | -0,22 | -0,30 | 382.833.231,97 | 59,46 | | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|--------|---|---------------------|-----------------|----------------------|---------------|------------|------------------|---------|
| QUELUZ | ORLA | BRA1 FI RENDA FIXA | 1,46 | -0,50 | -1,96 | 486.027,17 | 0,08 | 11.653.090,22 | 4,17 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI | 0,50 | 0,16 | 1,16 | 47.707.144,14 | 7,41 | 3.344.605.737,75 | 1,43 |
| VERITAS | RJI | FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | 7,08 | -0,39 | -0,66 | 1.070.414,63 | 0,17 | 163.198.729,80 | 0,66 |
| GRAPHEN | RJI | LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 1,89 | 0,04 | -0,11 | 3.743.180,44 | 0,58 | 70.924.696,78 | 5,28 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | 0,55 | 0,13 | 1,00 | 53.006.766,38 | 8,23 | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|---------|---------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|---------------|---------|
| GRAPHEN | RJI | LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | 3,64 | 0,27 | -1,84 | 1.802.128,28 | 0,28 | 71.347.917,59 | 2,53 |
| FINAXIS | FINAXIS | FIDC PREMIUM | 7,32 | -0,20 | -4,40 | 1.692.906,84 | 0,26 | 81.898.860,94 | 2,07 |
| BRPP | BRPP | FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| BRPP | GENIAL | FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.957,59 | 0,00 |
| BRPP | GENIAL | FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.125,27 | 0,00 |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a | | | 3,95 | 0,04 | -3,10 | 3.495.035,12 | 0,54 | | |
| Renda Fixa | | | 2,50 | -0,19 | 0,63 | 491.688.720,39 | 76,37 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,20%

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|-------------|------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| AZ QUEST | BEM | AZ QUEST ACOES FIC FIA | 19,71 | -5,02 | 2,31 | 29.418.376,79 | 4,57 | 653.341.872,03 | 4,50 |
| AZ QUEST | BEM | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 20,29 | -4,44 | 8,25 | 25.323.434,72 | 3,93 | 1.704.868.967,48 | 1,49 |
| BNP PARIBAS | BNP PARIBAS | BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 19,84 | -4,68 | 0,56 | 29.875.873,21 | 4,64 | 305.220.195,92 | 9,79 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 18,67 | -3,08 | 8,77 | 30.762.522,95 | 4,78 | 3.453.398.725,17 | 0,89 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 18,93 | -4,29 | 4,76 | 115.380.207,67 | 17,92 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------|--------------|---------|
| GRAPHEN | ORLA | LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | 0,35 | -0,40 | -2,79 | 223.869,33 | 0,03 | 1.585.443,10 | 14,12 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 0,35 | -0,40 | -2,79 | 223.869,33 | 0,03 | | |

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|---------------|---------|
| BRPP | BNY MELLON | GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA | 93,18 | -0,31 | 146,56 | 537.528,80 | 0,08 | 19.744.814,12 | 2,72 |
| QUELUZ | BNY MELLON | BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | 0,48 | -0,11 | -0,77 | 1.519.286,74 | 0,24 | 28.066.112,58 | 5,41 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a | | | 17,23 | -0,16 | 17,59 | 2.056.815,54 | 0,32 | | |

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

| 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 | 12,66 | 2,89 | 3,14 | 2.297.000,00 | 0,36 | 1.322.246.699,64 | 0,17 |
| QUELUZ | PLANNER | VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII | 49,37 | -1,44 | -1,32 | 1.424.719,13 | 0,22 | 31.376.185,18 | 4,54 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BRRCR11 | 12,32 | 0,58 | -5,11 | 262.958,46 | 0,04 | 2.861.919.636,26 | 0,01 |
| AQUILLA | ÍNDIGO | ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | 2,20 | -0,30 | -2,09 | 1.997.654,49 | 0,31 | 181.485.441,09 | 1,10 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b | | | 16,63 | 0,98 | 2,44 | 5.982.332,08 | 0,93 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| | | | | | |
|---|-------|-------|------|----------------|-------|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | 17,46 | -3,97 | 4,87 | 123.643.224,62 | 19,20 |
|---|-------|-------|------|----------------|-------|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,43%

Artigo 9º A, 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 | 22,99 | 1,16 | -9,21 | 13.618.324,43 | 2,12 | 1.628.451.694,19 | 0,84 |
| SCHRODER | BEM | SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE | 21,16 | 6,34 | 16,25 | 14.891.317,18 | 2,31 | 244.602.296,68 | 6,09 |
| Sub-total Artigo 9º A, II | | | 18,37 | 3,80 | 12,13 | 28.509.641,61 | 4,43 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 18,37 | 3,80 | 12,13 | 28.509.641,61 | 4,43 | | |
| Total | | | 4,53 | -0,77 | 1,31 | 643.841.586,62 | 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 | 52.353.686,92 | 8,13 | 5,00 | 10,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 382.833.231,97 | 59,46 | 10,00 | 52,50 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 53.006.766,38 | 8,23 | 0,00 | 10,00 | 40,00 | 0,00 | 45,00 |
| Artigo 7º VII, Alínea a | Cota Sênior de FIDC | 3.495.035,12 | 0,54 | 0,00 | 0,50 | 3,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 491.688.720,39 | 76,37 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 115.380.207,67 | 17,92 | 5,00 | 17,50 | 20,00 | 0,00 | 25,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 223.869,33 | 0,03 | 0,00 | 0,50 | 5,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea a | Fundos de Participações | 2.056.815,54 | 0,32 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea b | Fundos de Investimentos Imobiliários | 5.982.332,08 | 0,93 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 123.643.224,62 | 19,20 | | | | | 35,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º A, II | Fundos de Investimento no Exterior | 28.509.641,61 | 4,43 | 0,00 | 5,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 28.509.641,61 | 4,43 | | | | | 10,00 |

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 | -0,29 -81,92 | 4,43 270,69 | 0,67 71,51 | 3,22 216,89 | 12,39 507,39 | -152.969,42 | 3.342.634,28 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | -0,22 -62,11 | -0,30 -18,44 | 0,34 36,19 | 0,04 2,87 | 1,71 70,09 | -848.374,66 | -685.140,43 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,13 36,75 | 1,00 61,19 | 0,65 69,65 | 0,91 61,36 | 1,01 41,39 | 69.191,21 | 526.627,77 |
| Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI | 0,04 11,42 | -3,10 -189,13 | -1,62 -173,19 | -3,02 -202,91 | -1,10 -44,94 | 1.418,40 | -111.719,21 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -4,29 -0,35 | 4,76 2,42 | 2,23 -0,21 | 7,28 1,42 | 15,58 -2,77 | -5.173.635,10 | 5.240.992,41 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | -0,40 3,54 | -2,79 -5,13 | -1,20 -3,64 | -2,42 -8,27 | -4,79 -23,14 | -906,10 | -6.436,25 |
| Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -0,16 3,78 | 17,59 15,25 | 18,33 15,88 | 17,82 11,97 | 16,29 -2,07 | -3.368,79 | 307.673,40 |
| Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | 0,98 4,92 | 2,44 0,11 | 2,83 0,39 | 3,95 -1,90 | 6,62 -11,73 | 67.170,79 | 222.328,22 |
| Artigo 9º A, II % do CDI | 3,80 1.069,65 | 12,13 740,37 | -2,34 -249,98 | 5,51 371,07 | | 1.044.725,11 | -730.697,57 |
| HORTOLÂNDIA (Total) | | | | | | -4.996.748,56 | 8.106.262,62 |

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150545 | 16.503.494,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.409.511,00 | -93.983,71 | -379.253,72 |
| NTN-B 150824 | 36.003.161,63 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 35.944.175,92 | -58.985,71 | 33.413,41 |
| | | | | | 52.353.686,92 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 48.145.325,92 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 48.025.128,70 | -120.197,22 | -450.360,43 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|--------------|---------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 71.823.772,10 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 71.548.298,76 | -275.473,34 | -867.900,60 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 88.732.206,49 | 5.340.000,00 | -3.200.000,00 | 0,00 | 91.024.826,54 | 152.620,05 | 751.019,27 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 97.553.336,35 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 97.489.987,44 | -63.348,91 | 994.133,70 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 13.681.840,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.617.687,78 | -64.153,13 | -1.047.155,99 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 61.605.124,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 61.127.302,75 | -477.822,11 | -64.876,38 |
| | | | | | 382.833.231,97 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRA1 FI RENDA FIXA | 488.465,98 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 486.027,17 | -2.438,81 | -11.072,22 |
| FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | 1.074.568,15 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.070.414,63 | -4.153,52 | -7.445,88 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 47.632.894,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 47.707.144,14 | 74.250,12 | 549.100,80 |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 3.741.647,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.743.180,44 | 1.533,42 | -3.954,93 |
| | | | | | 53.006.766,38 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 7º VII, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIDC PREMIUM | 1.696.349,78 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.692.906,84 | -3.442,94 | -77.985,62 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | 1.797.266,94 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.802.128,28 | 4.861,34 | -33.733,59 |
| | | | | | 3.495.035,12 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º II, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| AZ QUEST ACOES FIC FIA | 30.971.783,32 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 29.418.376,79 | -1.553.406,53 | 664.644,36 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 26.500.950,12 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 25.323.434,72 | -1.177.515,40 | 1.930.913,85 |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 31.342.177,14 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 29.875.873,21 | -1.466.303,93 | 165.127,75 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|------------------------|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 31.738.932,19 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 30.762.522,95 | -976.409,24 | 2.480.306,45 |
| | | | | | 115.380.207,67 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º III

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | 224.775,43 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 223.869,33 | -906,10 | -6.436,25 |
| | | | | | 223.869,33 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º IV, Alínea a

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | 1.520.964,53 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.519.286,74 | -1.677,79 | -11.764,59 |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA | 539.219,80 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 537.528,80 | -1.691,00 | 319.516,75 |
| | | | | | 2.056.815,54 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º IV, Alínea b

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRCR11 | 262.926,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.493,16 | 262.958,46 | 1.525,62 | -14.346,49 |
| FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII | 2.257.000,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 24.800,00 | 2.297.000,00 | 64.800,00 | 67.800,00 |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII | 1.645.588,24 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 227.664,79 | 1.424.719,13 | 6.795,68 | 211.506,18 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | 2.003.605,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.997.654,49 | -5.950,51 | -42.631,47 |
| | | | | | | 5.982.332,08 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 9º A, II

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 13.461.606,26 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.618.324,43 | 156.718,17 | -1.381.675,57 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE | 14.003.310,24 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.891.317,18 | 888.006,94 | 650.978,00 |
| | | | | | 28.509.641,61 | 0,00 | 0,00 |

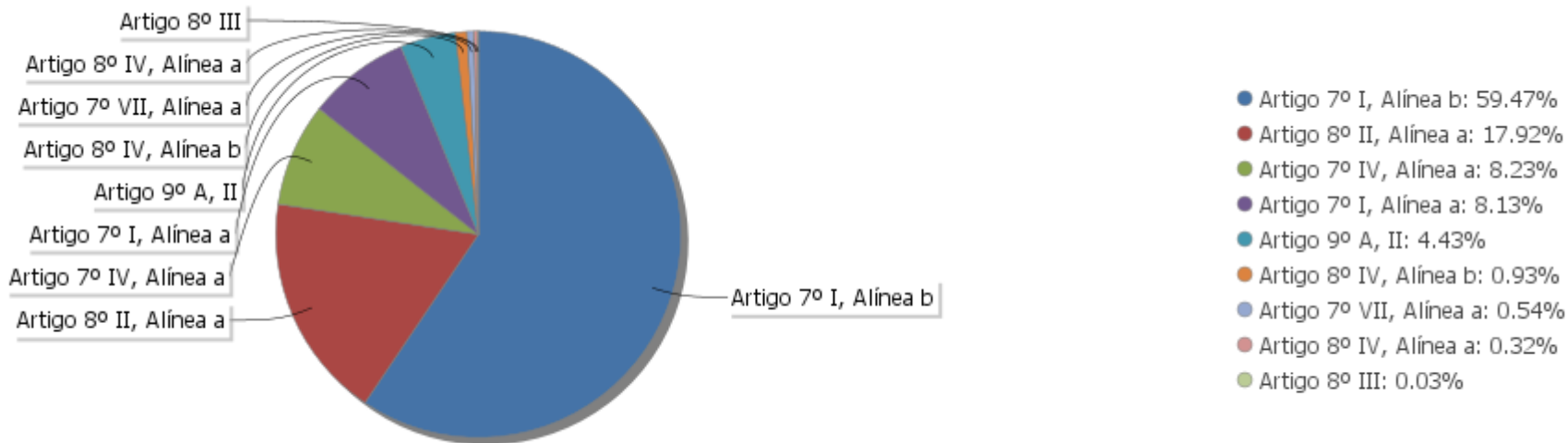
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

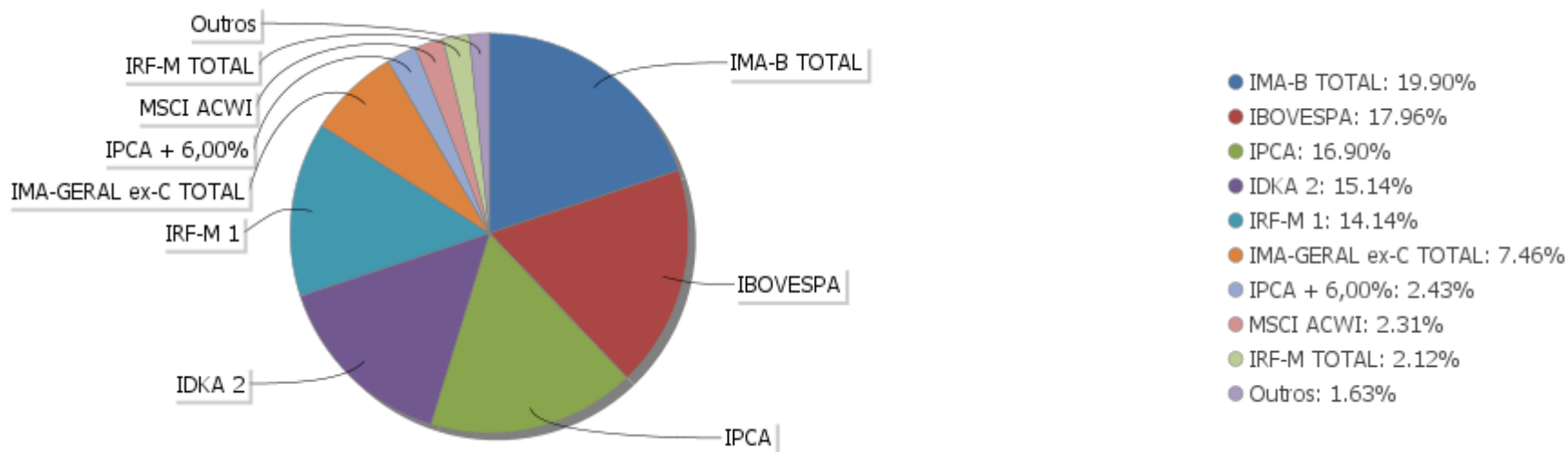
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 549.706.380,89 | 85,38 | 549.706.380,89 | 85,38 |
| de 31 a 365 dias | 30.762.522,95 | 4,78 | 580.468.903,84 | 90,16 |
| acima de 365 dias | 63.372.682,78 | 9,84 | 643.841.586,62 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

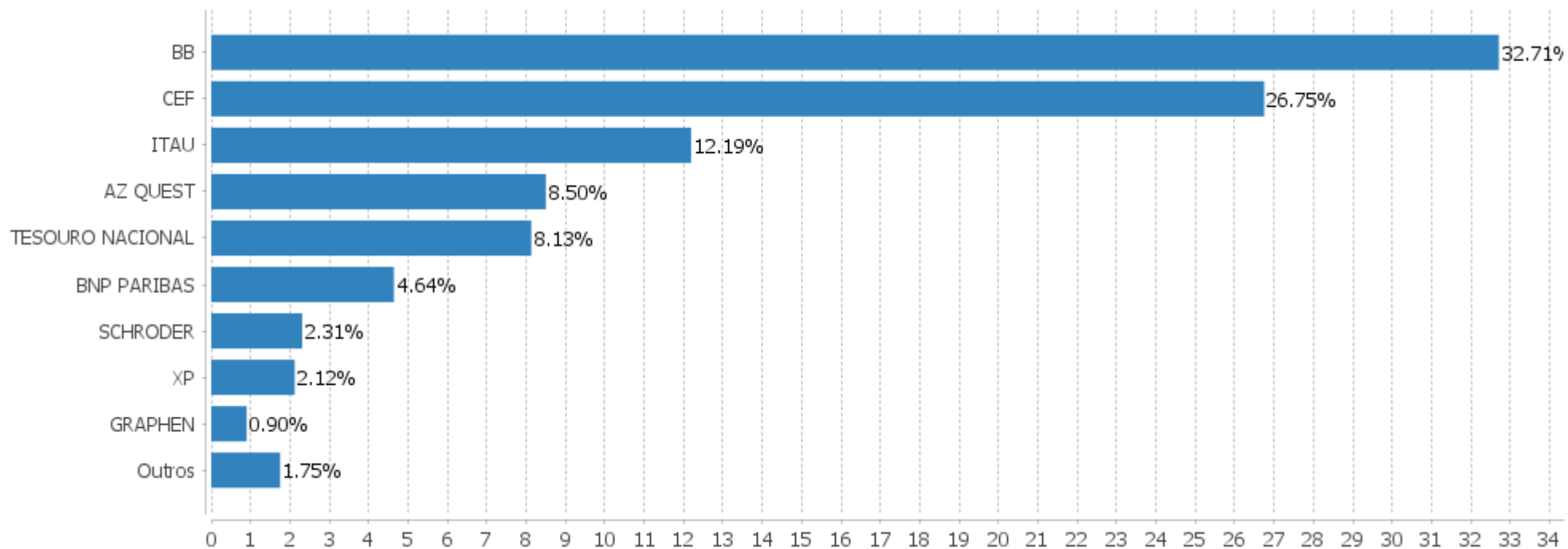


Alocação Por Estratégia



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 |
|----------------|-------|-------|-------|------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-----------|
| 2021 | -0,37 | -0,60 | 0,51 | 1,09 | 1,28 | 0,17 | -0,77 | | | | | | 1,31 |
| IPCA + 5,41% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,27 | 0,97 | 1,43 | | | | | | 7,99 |
| p.p. indexador | -1,04 | -1,84 | -0,90 | 0,36 | 0,01 | -0,80 | -2,19 | | | | | | -6,68 |
| 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

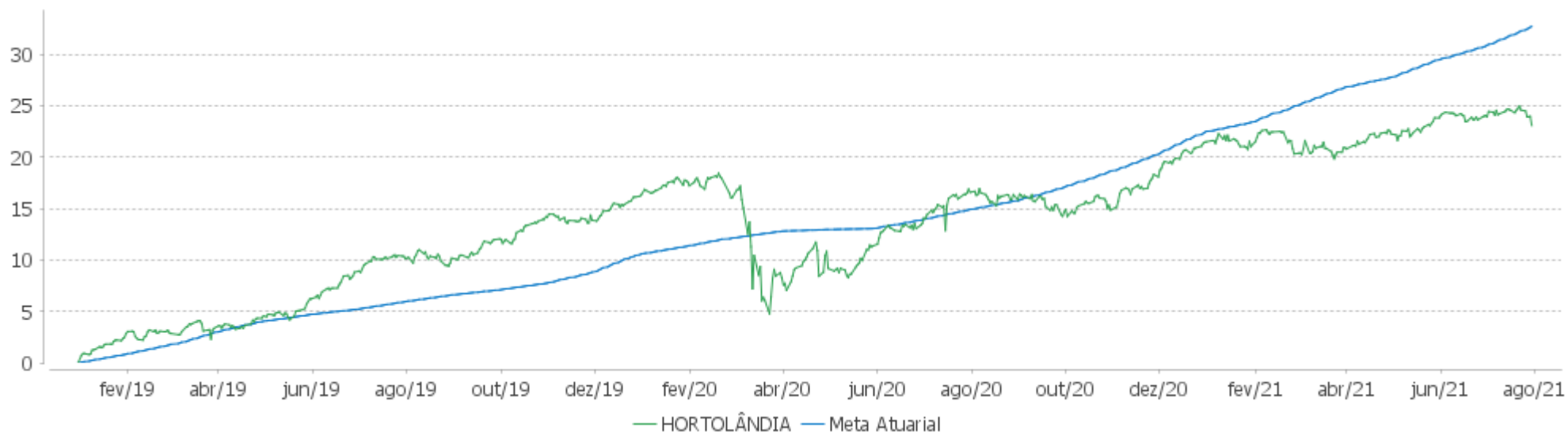
| | Quantidade | Perc. (%) |
|---------------------------------|---------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 17 | 54,84 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 14 | 45,16 |
| | Rentabilidade | Mês |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,88 | 2020-12 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,76 | 2020-03 |

Relatório

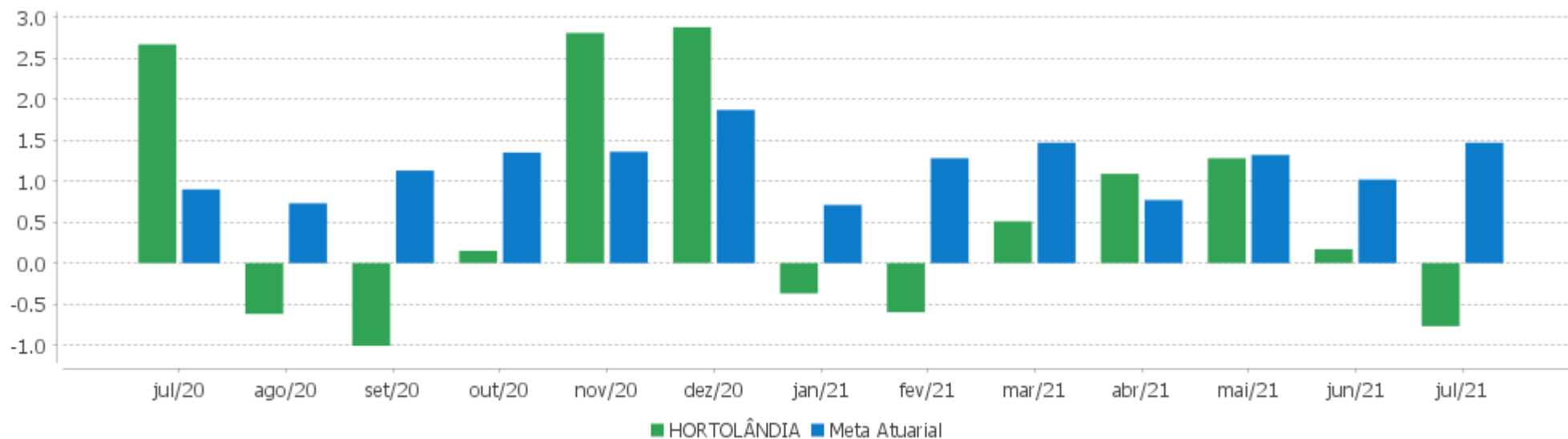
| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses | 0,68 | 3,72 | -3,04 | 3,71 |
| 06 meses | 1,68 | 7,27 | -5,59 | 4,26 |
| 12 meses | 5,57 | 15,05 | -9,48 | 4,53 |
| 24 meses | 11,76 | 24,71 | -12,95 | 7,58 |
| Desde 31/12/2018 | 23,06 | 32,11 | -9,05 | 6,88 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|-----------------|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------------|-------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | -0,25 -0,15 | -0,93 -0,49 | 0,34 -0,38 | -0,38 -0,38 | 0,55 -0,41 | 7,68 -0,42 | 24,46 0,00 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 0,16 -0,02 | 0,82 -0,18 | 0,52 -0,08 | 0,79 -0,17 | 1,58 -0,40 | 6,89 -0,72 | 14,43 -1,01 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | -0,78 -1,74 | -0,06 -4,83 | -0,54 -2,88 | -0,09 -4,59 | 0,90 -8,10 | 10,67 -0,84 | 29,39 14,29 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | -0,06 0,11 | 1,50 -0,19 | 0,50 0,12 | 1,36 -0,17 | 5,46 -0,43 | 14,00 -1,08 | 27,53 -2,04 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,38 -0,01 | -1,20 -0,11 | 1,05 -0,06 | -0,34 -0,09 | 2,27 -0,25 | 10,39 -0,50 | 40,32 -1,03 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p. | -0,47 0,01 | -2,15 -0,10 | -0,12 -0,06 | -1,39 -0,14 | -1,63 -0,23 | 7,76 -0,52 | 23,91 -0,91 |
| BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,50 -0,13 | -1,96 -0,87 | -0,93 -2,03 | -1,66 -1,42 | -2,67 -5,20 | -44,43 -55,32 | -67,20 -108,55 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p. | 0,16 -0,80 | 1,16 -3,60 | 0,71 -1,62 | 1,03 -3,47 | 1,19 -7,80 | 6,46 -5,05 | 20,65 5,55 |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,04 0,41 | -0,11 0,99 | 0,52 -0,58 | 0,17 0,42 | -0,52 -3,05 | -0,09 -10,98 | -14,02 -55,37 |
| FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p. | -0,39 -0,42 | -0,66 -1,97 | -0,83 -1,42 | -0,32 -1,53 | 0,33 -4,72 | -5,41 -19,75 | -14,26 -44,70 |
| NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,16 0,21 | 0,09 1,18 | 0,08 -1,03 | 0,24 0,48 | 3,09 0,57 | 14,88 3,99 | 37,92 -3,42 |
| NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,57 -0,20 | -2,19 -1,10 | 1,98 0,87 | -0,64 -0,40 | 1,39 -1,14 | 7,73 -3,16 | 50,85 9,50 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | -94,34 -1.395,82 | -98,25 -725,96 |
| FIDC PREMIUM % do CDI | -0,20 -57,07 | -4,40 -268,88 | -3,74 -398,97 | -4,21 -283,15 | 1,26 51,71 | -9,80 -145,02 | -18,33 -135,46 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | -94,34 -1.395,82 | -98,25 -725,95 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | -94,34 -1.395,82 | -98,25 -725,96 |
| LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC | 0,27 | -1,84 | 0,45 | -1,87 | -3,21 | -8,08 | 1.289,30 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
| % do CDI | 76,06 | -112,19 | 48,14 | -125,70 | -131,71 | -119,50 | 9.526,84 |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p. | -4,68 -0,73 | 0,56 -1,78 | 2,27 -0,18 | 3,93 -1,92 | 13,72 -4,63 | 17,66 -1,97 | 52,08 -1,67 |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | -5,02 -1,07 | 2,31 -0,03 | 0,78 -1,66 | 5,08 -0,77 | 9,87 -8,49 | 10,77 -8,87 | 41,87 -11,88 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p. | -4,44 -0,50 | 8,25 5,92 | 1,64 -0,81 | 10,37 4,51 | 15,22 -3,14 | 28,77 9,14 | 87,80 34,05 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p. | -3,08 0,87 | 8,77 6,43 | 4,14 1,69 | 10,39 4,53 | 23,74 5,39 | 22,61 2,98 | 71,58 17,83 |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI | -0,40 -113,36 | -2,79 -170,63 | -1,20 -128,05 | -2,42 -162,88 | -4,79 -196,09 | -3,32 -49,16 | -94,92 -701,36 |
| BRCR11 Var. IBOVESPA p.p. | 0,58 4,52 | -5,11 -7,45 | -3,62 -6,07 | -6,86 -12,71 | -4,99 -23,34 | -6,42 -26,05 | 18,93 -34,82 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p. | -0,30 -2,81 | -2,09 -0,49 | -0,78 0,52 | -1,94 -0,01 | -1,22 -4,55 | -2,29 -8,48 | -20,43 -51,52 |
| FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI | 2,89 812,83 | 3,14 191,63 | 8,13 867,98 | 6,18 416,14 | -0,91 -37,46 | -3,15 -46,66 | -85,42 -631,21 |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII Var. IFIX p.p. | -1,44 -3,96 | -1,32 0,29 | -2,51 -1,22 | 0,23 2,15 | 11,96 8,63 | 7,49 1,30 | 14,70 -16,38 |
| GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p. | -0,31 -1,79 | 146,56 138,23 | 150,83 146,97 | 147,70 140,14 | 136,39 120,91 | -92,59 -117,85 | -92,55 -129,54 |
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p. | -0,11 -1,59 | -0,77 -9,10 | -0,31 -4,17 | -0,61 -8,18 | -1,61 -17,09 | 30,50 5,23 | -21,76 -58,75 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p. | 6,34 3,35 | 16,25 5,81 | 0,63 2,82 | 9,39 4,03 | | | |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p. | 1,16 -0,31 | 3,40 -4,93 | -5,39 -9,26 | -0,87 -8,43 | 26,07 10,59 | | |
| HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 6,00% p.p. | -0,77 -2,24 | 1,31 -7,02 | 0,68 -3,19 | 1,68 -5,88 | 5,57 -9,91 | 11,76 -13,51 | |
| CDI | 0,36 | 1,64 | 0,94 | 1,49 | 2,44 | 6,76 | 13,53 |
| IBOVESPA | -3,94 | 2,34 | 2,44 | 5,85 | 18,35 | 19,63 | 53,75 |
| INPC + 6,00% | 1,54 | 8,59 | 4,13 | 7,80 | 16,39 | 26,73 | 38,51 |
| IPCA + 6,00% | 1,47 | 8,33 | 3,86 | 7,56 | 15,48 | 25,26 | 36,99 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|----------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 0,19 | 1,00 | 0,60 | 0,96 | 1,99 | 7,60 | 15,44 | 23,97 | 40,68 |
| IRF-M 1+ | -0,83 | -4,11 | -0,42 | -2,76 | -3,34 | 8,28 | 28,38 | 38,97 | 66,27 |
| IRF-M TOTAL | -0,47 | -2,04 | -0,06 | -1,25 | -1,40 | 8,27 | 24,82 | 34,87 | 59,02 |
| IMA-B 5 | 0,03 | 1,31 | 0,59 | 1,21 | 5,06 | 14,34 | 30,43 | 41,23 | 60,61 |
| IMA-B 5+ | -0,76 | -3,29 | 1,44 | -1,63 | 0,34 | 8,18 | 49,88 | 56,72 | 81,63 |
| IMA-B TOTAL | -0,37 | -1,09 | 1,10 | -0,24 | 2,53 | 10,89 | 41,35 | 50,46 | 72,98 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | -0,10 | -0,44 | 0,72 | -0,00 | 0,96 | 8,10 | 24,45 | 33,52 | 54,06 |
| IMA-GERAL TOTAL | -0,10 | 0,04 | 0,87 | 0,28 | 1,67 | 9,12 | 25,92 | 35,34 | 55,62 |
| IDKA 2 | -0,18 | 1,68 | 0,38 | 1,54 | 5,88 | 15,07 | 29,57 | 41,20 | 61,95 |
| IDKA 20 | -1,44 | -5,02 | 1,98 | -2,27 | -1,21 | 3,68 | 67,33 | 69,21 | 99,56 |
| CDI | 0,36 | 1,64 | 0,94 | 1,49 | 2,44 | 6,76 | 13,53 | 21,57 | 36,78 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -3,94 | 2,34 | 2,44 | 5,85 | 18,35 | 19,63 | 53,75 | 84,77 | 112,54 |
| IBRX 100 | -3,99 | 4,47 | 2,33 | 7,73 | 20,73 | 23,34 | 61,40 | 92,00 | 121,47 |
| IBRX 50 | -3,85 | 4,91 | 2,77 | 7,91 | 22,23 | 22,51 | 54,85 | 86,08 | 113,55 |
| SMALL CAP | -5,80 | 4,96 | 1,45 | 8,69 | 20,13 | 29,57 | 86,53 | 106,58 | 160,32 |
| IFIX | 2,51 | -1,60 | -1,29 | -1,92 | 3,33 | 6,19 | 31,08 | 36,68 | 62,68 |
| Índice Consumo - ICON | -5,22 | -2,08 | 1,59 | -0,81 | 2,95 | 15,45 | 58,99 | 62,68 | 71,63 |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,72 | 0,31 | 1,58 | 5,67 | 14,21 | 18,21 | 67,31 | 86,37 | 136,91 |

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 | 0,96 | 4,76 | 2,34 | 4,50 | 8,99 | 11,51 | 15,10 | 20,26 | 23,52 |
| INPC | 1,02 | 5,01 | 2,60 | 4,73 | 9,85 | 12,81 | 16,38 | 20,58 | 23,08 |
| IGPM | 0,78 | 15,98 | 5,54 | 13,06 | 33,83 | 46,23 | 55,58 | 68,40 | 65,60 |
| SELIC | 0,36 | 1,64 | 0,94 | 1,49 | 2,44 | 6,76 | 13,54 | 21,59 | 36,81 |

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 | 4,72 | 15,33 | -0,37 | 10,68 | 32,26 | 100,62 | 112,87 | 191,07 | 219,74 |
| MSCI ACWI | 2,99 | 10,44 | -2,20 | 5,36 | 29,16 | 87,89 | 90,03 | 148,07 | 175,22 |
| MSCI World | 4,15 | 12,45 | -1,01 | 7,85 | 31,07 | 90,86 | 94,44 | 156,03 | 181,87 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,31 | 7,15 | 3,36 | 6,55 | 13,32 | 20,59 | 29,41 | 40,58 | 50,15 |
| IPCA + 5,00% | 1,39 | 7,74 | 3,61 | 7,06 | 14,40 | 22,91 | 33,17 | 46,04 | 57,47 |
| IPCA + 5,50% | 1,43 | 8,04 | 3,74 | 7,31 | 14,94 | 24,08 | 35,07 | 48,83 | 61,23 |
| IPCA + 5,89% | 1,47 | 8,27 | 3,84 | 7,51 | 15,36 | 25,00 | 36,57 | 51,03 | 64,22 |
| IPCA + 6,00% | 1,47 | 8,33 | 3,86 | 7,56 | 15,48 | 25,26 | 36,99 | 51,65 | 65,07 |
| INPC + 4,00% | 1,37 | 7,41 | 3,63 | 6,79 | 14,21 | 22,00 | 30,85 | 40,95 | 49,61 |
| INPC + 6,00% | 1,54 | 8,59 | 4,13 | 7,80 | 16,39 | 26,73 | 38,51 | 52,05 | 64,49 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

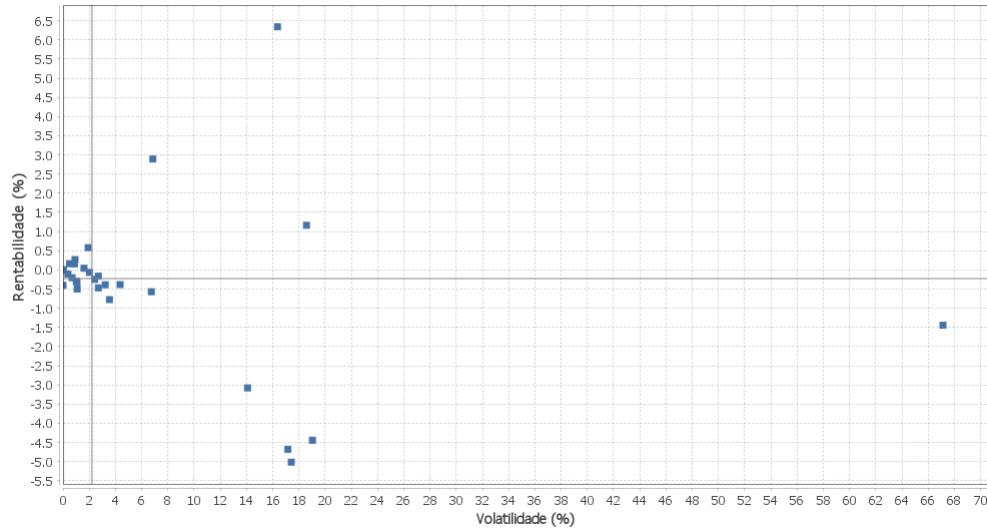
Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|--------------|--------------|--------------------|--------------|
| 50 | 08/07/2021 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 4.940.000,00 | 0,00 | 1.800.403,14656400 | 2,7438299080 |
| 48 | 08/07/2021 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 400.000,00 | 0,00 | 145.781,63130000 | 2,7438299080 |
| 52 | 28/07/2021 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,00 | 3.100.000,00 | 1.128.413,85363200 | 2,7472190190 |
| 49 | 28/07/2021 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,00 | 100.000,00 | 36.400,44689100 | 2,7472190190 |
| Total | | | | | | |

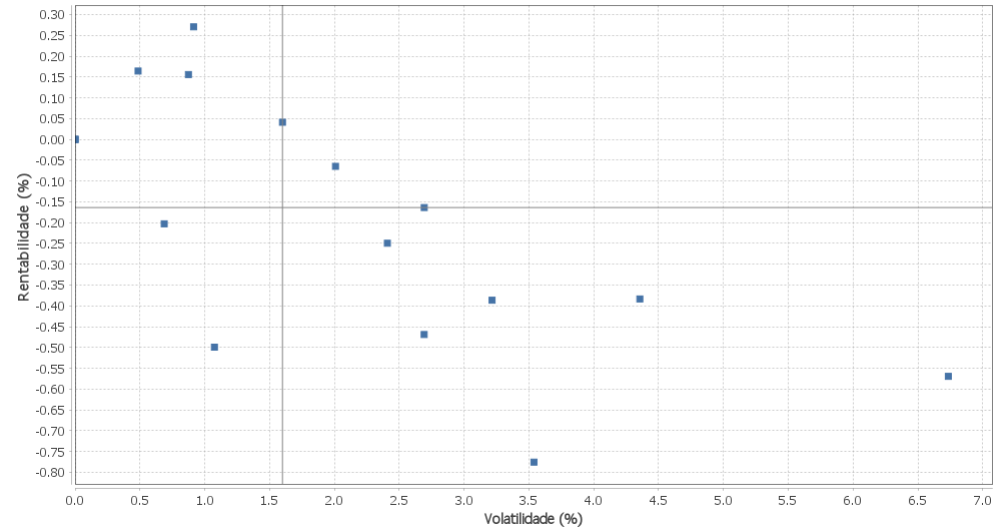
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

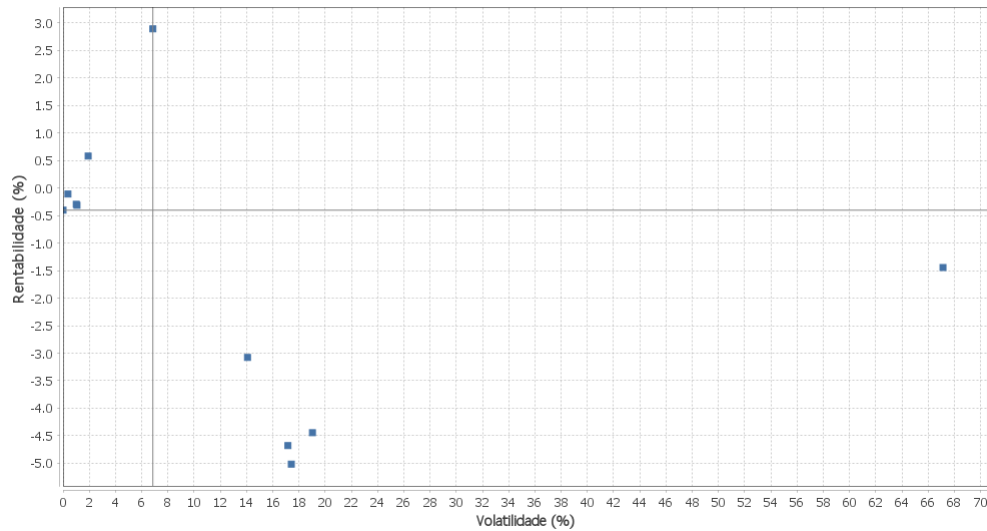
HORTOLÂNDIA - No Mês



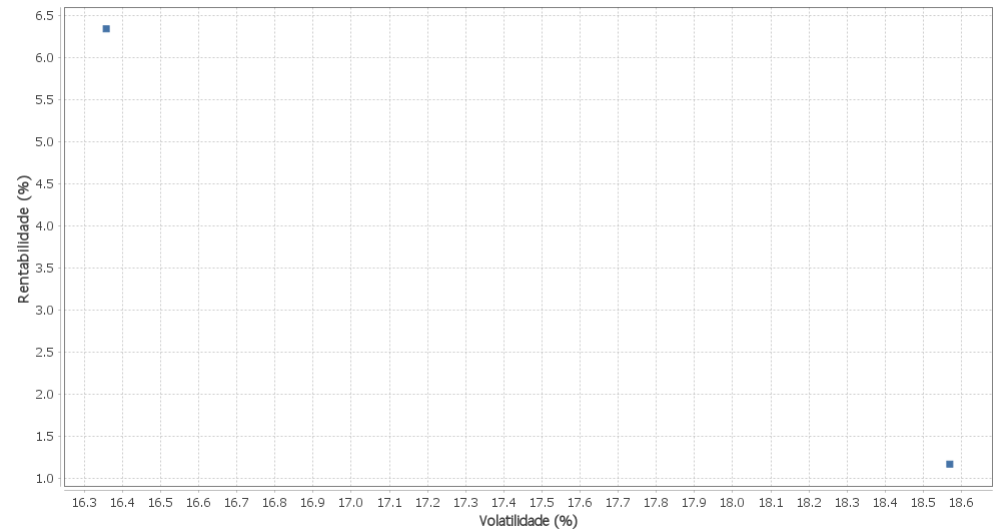
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 11.060.245,55

Value-At-Risk: 1,72%

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-------------------------|--------------|------|-------|-----------|-------|---------------|------------|
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,00 | NaN | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,00 | NaN | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,00 | NaN | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V | Artigo 8º III | 0,00 | 0,02 | 0,00 | -1.248,94 | -0,40 | 223.869,33 | 0,03 |
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | Artigo 8º IV, Alínea a | 0,37 | 0,02 | 0,00 | -1,25 | -0,11 | 1.519.286,74 | 0,24 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 0,49 | 0,17 | 0,01 | -0,39 | 0,16 | 91.024.826,54 | 14,14 |
| FIDC PREMIUM | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,69 | 0,19 | 0,00 | -0,81 | -0,20 | 1.692.906,84 | 0,26 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,87 | 0,17 | 0,00 | -0,23 | 0,16 | 47.707.144,14 | 7,41 |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | Artigo 7º VII, Alínea a | 0,91 | 0,04 | -0,00 | -0,09 | 0,27 | 1.802.128,28 | 0,28 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | Artigo 8º IV, Alínea b | 1,01 | 0,08 | 0,00 | -0,65 | -0,30 | 1.997.654,49 | 0,31 |
| GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA | Artigo 8º IV, Alínea a | 1,06 | 4,17 | -0,00 | -0,63 | -0,31 | 537.528,80 | 0,08 |
| BRA1 FI RENDA FIXA | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,07 | 0,66 | 0,00 | -0,80 | -0,50 | 486.027,17 | 0,08 |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,60 | 0,74 | 0,00 | -0,20 | 0,04 | 3.743.180,44 | 0,58 |
| BRCR11 | Artigo 8º IV, Alínea b | 1,92 | 2,66 | -0,00 | 0,12 | 0,58 | 262.958,46 | 0,04 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,01 | 1,28 | 0,14 | -0,21 | -0,06 | 97.489.987,44 | 15,14 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,41 | 1,20 | 0,07 | -0,25 | -0,25 | 48.025.128,70 | 7,46 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,69 | 1,27 | 0,02 | -0,31 | -0,47 | 13.617.687,78 | 2,12 |
| NTN-B 150824 | Artigo 7º I, Alínea a | 2,69 | 1,81 | 0,07 | -0,19 | -0,16 | 35.944.175,92 | 5,58 |
| FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 | Artigo 7º IV, Alínea a | 3,22 | 1,59 | 0,00 | -0,23 | -0,39 | 1.070.414,63 | 0,17 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 3,54 | 1,03 | 0,07 | -0,32 | -0,78 | 61.127.302,75 | 9,49 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 4,36 | 2,32 | 0,19 | -0,17 | -0,38 | 71.548.298,76 | 11,11 |
| NTN-B 150545 | Artigo 7º I, Alínea a | 6,73 | 3,69 | 0,07 | -0,14 | -0,57 | 16.409.511,00 | 2,55 |
| FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII | Artigo 8º IV, Alínea b | 6,85 | 3,16 | -0,00 | 0,37 | 2,89 | 2.297.000,00 | 0,36 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | Artigo 8º II, Alínea a | 14,07 | 6,76 | 0,26 | -0,24 | -3,08 | 30.762.522,95 | 4,78 |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE | Artigo 9º A, II | 16,36 | 8,80 | -0,03 | 0,37 | 6,34 | 14.891.317,18 | 2,31 |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | Artigo 8º II, Alínea a | 17,15 | 7,34 | 0,29 | -0,29 | -4,68 | 29.875.873,21 | 4,64 |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 17,41 | 7,04 | 0,28 | -0,31 | -5,02 | 29.418.376,79 | 4,57 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA | Artigo 9º A, II | 18,57 | 9,57 | 0,01 | 0,04 | 1,16 | 13.618.324,43 | 2,12 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------------------|------------------------|--------------|------|------|--------|-------|---------------|------------|
| INVESTIMENTO NO EXTERIOR | | | | | | | | |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 19,03 | 7,51 | 0,25 | -0,25 | -4,44 | 25.323.434,72 | 3,93 |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII | Artigo 8º IV, Alínea b | 67,13 | 8,02 | 0,00 | -0,03 | -1,44 | 1.424.719,13 | 0,22 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de julho de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 14,12% do patrimônio líquido do fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V (Art. 8, Inciso III), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 5,41% do patrimônio líquido do fundo BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;