



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
ABRIL 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 29.04.2022.

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

72,24%

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 IDKA2 | 2,56 | 1,48 | 5,36 | 17.691.477,61 | 7,45 | 9.105.588.612,67 | 0,19 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 2,64 | 1,54 | 5,36 | 24.891.921,26 | 10,48 | 1.213.440.846,98 | 2,05 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,68 | 1,40 | 5,28 | 16.070.216,03 | 6,76 | 11.053.598.876,15 | 0,15 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2,67 | 1,53 | 5,32 | 4.343.010,22 | 1,83 | 6.683.332.099,62 | 0,06 |
| BB | BB | BB PREV IPCA I | 1,55 | 2,05 | 6,18 | 17.837.090,40 | 7,51 | 541.508.469,24 | 3,29 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 2,44 | 1,61 | 5,52 | 80.833.715,52 | 34,02 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|-------------------|---------|
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,21 | 0,80 | 3,38 | 13.720.505,65 | 5,78 | 12.423.449.197,43 | 0,11 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,18 | 0,78 | 3,37 | 26.596.923,26 | 11,20 | 9.511.719.590,81 | 0,28 |
| BRAM | BRABESCO | BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 2,67 | 1,51 | 5,24 | 23.487.926,48 | 9,89 | 1.363.814.346,53 | 1,72 |
| WESTERN | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC | 0,16 | 0,68 | 3,24 | 15.884.343,87 | 6,69 | 1.350.671.923,88 | 1,18 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 0,66 | 0,99 | 3,89 | 79.689.699,26 | 33,54 | | |

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| BB | BB | BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | 2,95 | 1,34 | 5,15 | 7.053.829,80 | 2,97 | 631.922.483,93 | 1,12 |
| MONGERAL | BEM | MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO | 0,23 | 0,90 | 3,64 | 4.039.762,98 | 1,70 | 854.885.562,02 | 0,47 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea b | | | 2,07 | 1,22 | 4,74 | 11.093.592,78 | 4,67 | | |
| Renda Fixa | | | 2,22 | 1,30 | 4,70 | 171.617.007,56 | 72,24 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

11,78%

Artigo 8º I (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 SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 16,78 | -5,92 | -0,02 | 8.165.828,56 | 3,44 | 1.269.008.675,73 | 0,64 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 24,42 | -10,96 | -2,16 | 4.687.662,58 | 1,97 | 1.685.141.632,83 | 0,28 |
| OCCAM | BEM | OCCAM FIC FIA | 18,21 | -8,70 | 2,07 | 7.525.274,48 | 3,17 | 977.988.912,30 | 0,77 |
| GUEPARDO | DAYCOVAL | GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA | 23,49 | -9,97 | -9,23 | 3.630.846,67 | 1,53 | 110.491.947,07 | 3,29 |
| TARPON | DAYCOVAL | TARPON GT 30 FIC FIA | 18,21 | -6,40 | 7,53 | 3.986.053,44 | 1,68 | 471.471.568,57 | 0,85 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 17,08 | -8,15 | 0,85 | 27.995.665,73 | 11,78 | | |
| Renda Variável | | | 14,15 | -8,15 | 0,85 | 27.995.665,73 | 11,78 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,50%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|----------------------------------|-------------|-------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| WESTERN | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I | 22,07 | -10,34 | -32,32 | 13.069.837,39 | 5,50 | 2.267.085.184,51 | 0,58 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 22,07 | -10,34 | -32,32 | 13.069.837,39 | 5,50 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 22,07 | -10,34 | -32,32 | 13.069.837,39 | 5,50 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,96%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| WESTERN | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 16,65 | -8,78 | -11,46 | 21.274.543,44 | 8,95 | 1.661.618.698,88 | 1,28 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 16,65 | -8,78 | -11,46 | 21.274.543,44 | 8,95 | | |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|---------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|------------------|-------------|--------------|---------|
| PÁTRIA | PÁTRIA | PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP | 185,08 | 0,19 | -49,41 | 16.375,15 | 0,01 | 2.255.009,57 | 0,73 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 185,08 | 0,19 | -49,41 | 16.375,15 | 0,01 | | |

| | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|--------------|---------------|----------------------|-------------|--|--|
| Investimentos Estruturados | | | 22,41 | -8,77 | -11,51 | 21.290.918,59 | 8,96 | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|--------------|---------------|----------------------|-------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,52%

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 | BB | BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO | 30,42 | 0,82 | 5,30 | 2.429.031,65 | 1,02 | 112.715.459,16 | 2,16 |
| PLURAL | GENIAL | BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BFFF11 | 9,83 | 1,30 | 0,95 | 1.173.701,84 | 0,49 | 351.510.085,49 | 0,33 |
| Sub-total Artigo 11º | | | 4,76 | 0,98 | 3,85 | 3.602.733,49 | 1,52 | | |
| Fundos Imobiliários | | | 4,76 | 0,98 | 3,85 | 3.602.733,49 | 1,52 | | |
| Total | | | 4,47 | -1,55 | -0,30 | 237.576.162,76 | 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 b | Fundos 100% Títulos Públicos | 80.833.715,52 | 34,02 | 15,00 | 35,00 | 70,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 79.689.699,26 | 33,54 | 0,00 | 35,00 | 65,00 | 0,00 | 65,00 |
| Artigo 7º V, Alínea b | FI RF - Crédito Privado | 11.093.592,78 | 4,67 | 0,00 | 4,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 171.617.007,56 | 72,24 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 27.995.665,73 | 11,78 | 0,00 | 10,00 | 35,00 | 0,00 | 35,00 |
| | Total Renda Variável | 27.995.665,73 | 11,78 | | | | | 35,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Ações - BDR Nível I | 13.069.837,39 | 5,50 | 0,00 | 5,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 13.069.837,39 | 5,50 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 21.274.543,44 | 8,95 | 0,00 | 9,00 | 15,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 16.375,15 | 0,01 | 0,00 | 0,50 | 15,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 21.290.918,59 | 8,96 | | | | | 15,00 |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 3.602.733,49 | 1,52 | 0,00 | 1,50 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Fundos Imobiliários | 3.602.733,49 | 1,52 | | | | | 5,00 |

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 % do CDI | 1,61 193,06 | 5,52 168,37 | 5,34 211,40 | 8,35 178,38 | 7,62 107,69 | 1.281.366,47 | 4.233.648,56 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 0,99 118,65 | 3,89 118,58 | 3,25 128,59 | | | 754.951,90 | 3.251.382,12 |
| Artigo 7º V, Alínea b % do CDI | 1,22 145,75 | 4,74 144,47 | 4,50 177,84 | | | 165.595,58 | 667.478,59 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | -8,15 1,96 | 0,85 -2,06 | -3,12 0,68 | | | -2.482.521,55 | -42.579,76 |
| Artigo 9º III % do CDI | -10,34 -1.239,23 | -32,32 -985,74 | -21,44 -848,13 | -32,75 -699,95 | -22,11 -312,33 | -1.507.149,24 | -6.242.287,58 |
| Artigo 10º I % do CDI | -8,78 -1.052,01 | -11,46 -349,41 | -6,59 -260,79 | | | -2.046.982,83 | -2.752.893,33 |
| Artigo 10º II % do CDI | 0,19 23,28 | -49,41 -1.506,75 | -49,49 -1.957,27 | | | 31,75 | -15.991,55 |
| Artigo 11º % do CDI | 0,98 116,88 | 3,85 117,37 | 3,55 140,41 | | | 34.950,95 | 135.341,39 |
| DIADEMA (Total) | | | | | | -3.799.756,97 | -765.901,56 |

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 IPCA I | 17.478.591,21 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.837.090,40 | 358.499,19 | 1.043.244,19 |
| BB PREV RF IDKA2 | 17.432.794,99 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.691.477,61 | 258.682,62 | 899.651,93 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 4.277.669,59 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.343.010,22 | 65.340,63 | 219.552,45 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 15.848.264,75 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.070.216,03 | 221.951,28 | 805.425,19 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 24.515.028,51 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 24.891.921,26 | 376.892,75 | 1.265.774,80 |
| | | | | | 80.833.715,52 | 0,00 | 0,00 |

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|---------------|----------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 25.689.049,17 | 16.885.583,11 | -16.167.211,25 | 0,00 | 26.596.923,26 | 189.502,23 | 1.136.177,58 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 23.139.445,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 23.487.926,48 | 348.480,52 | 1.168.747,98 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 13.611.597,28 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.720.505,65 | 108.908,37 | 448.016,02 |
| WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC | 15.776.283,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.884.343,87 | 108.060,78 | 498.440,54 |
| | | | | | 79.689.699,26 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|---------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | 10.924.347,34 | 0,00 | -4.000.000,00 | 0,00 | 7.053.829,80 | 129.482,46 | 525.538,02 |
| MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO | 4.003.649,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.039.762,98 | 36.113,12 | 141.940,57 |
| | | | | | 11.093.592,78 | 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 | 8.679.577,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.165.828,56 | -513.748,80 | -1.367,69 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 5.264.669,14 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.687.662,58 | -577.006,56 | -103.412,15 |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA | 4.033.121,04 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.630.846,67 | -402.274,37 | -369.153,33 |
| OCCAM FIC FIA | 8.242.090,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.525.274,48 | -716.815,55 | 152.332,11 |
| TARPON GT 30 FIC FIA | 4.258.729,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.986.053,44 | -272.676,27 | 279.021,30 |
| | | | | | 27.995.665,73 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I | 14.576.986,63 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.069.837,39 | -1.507.149,24 | -6.242.287,58 |
| | | | | | 13.069.837,39 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 23.321.526,27 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.274.543,44 | -2.046.982,83 | -2.752.893,33 |
| | | | | | 21.274.543,44 | 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\$) |
|---------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP | 16.343,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.375,15 | 31,75 | -15.991,55 |
| | | | | | 16.375,15 | 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\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|-----------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO | 2.421.791,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.500,00 | 2.429.031,65 | 19.739,93 | 124.169,52 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 | 1.167.490,82 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.000,00 | 1.173.701,84 | 15.211,02 | 11.171,87 |
| | | | | | | 3.602.733,49 | 0,00 | 0,00 |

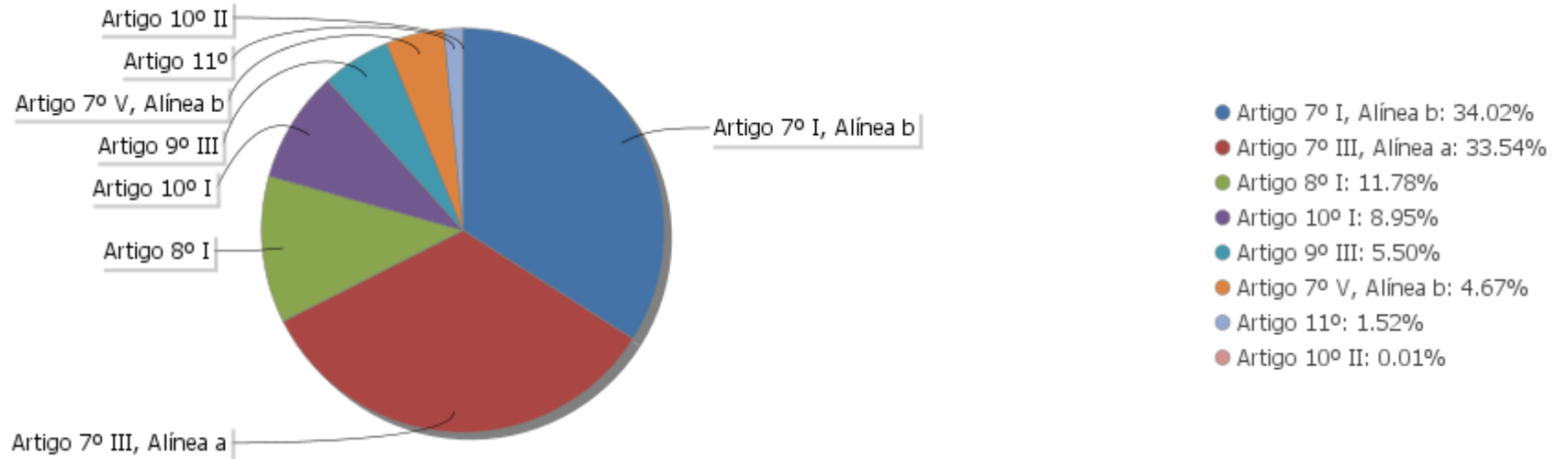
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

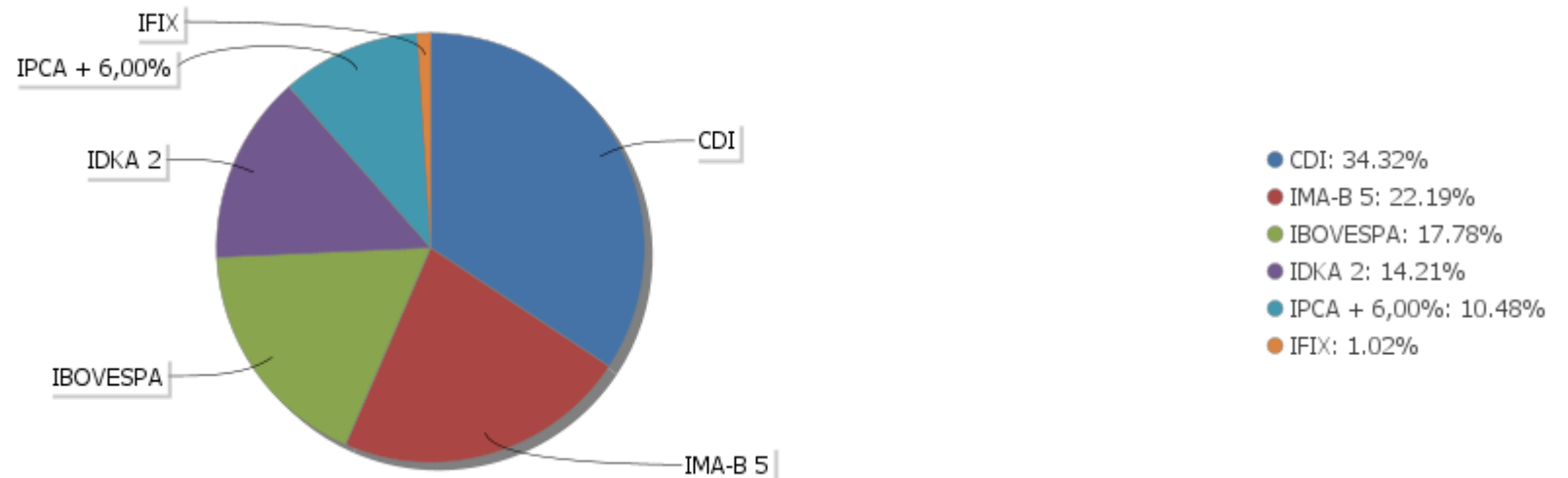
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 197.951.648,22 | 83,32 | 197.951.648,22 | 83,32 |
| de 31 a 365 dias | 30.141.653,09 | 12,69 | 228.093.301,31 | 96,01 |
| acima de 365 dias | 9.482.861,45 | 3,99 | 237.576.162,76 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

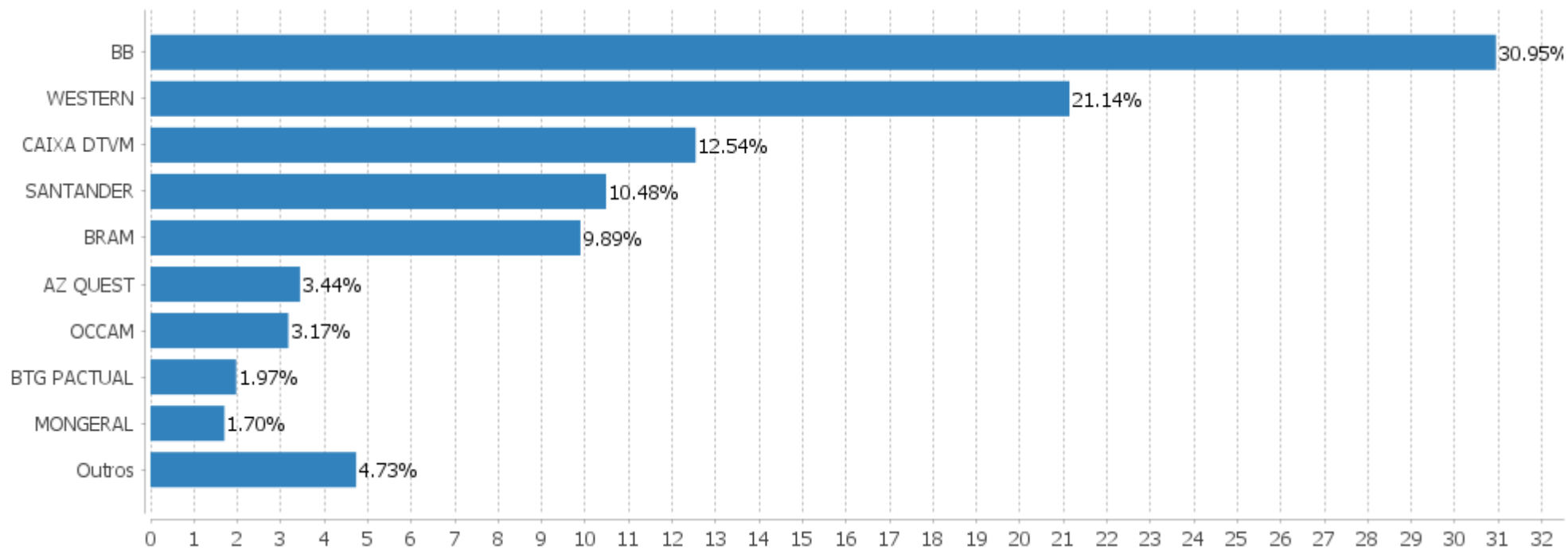


Alocação Por Estratégia



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 | -0,88 | -0,07 | 2,24 | -1,55 | | | | | | | | | -0,30 |
| IPCA + 4,89% | 0,94 | 1,37 | 2,04 | 1,42 | | | | | | | | | 5,91 |
| p.p. indexador | -1,82 | -1,44 | 0,20 | -2,97 | | | | | | | | | -6,21 |
| 2021 | -0,82 | -0,99 | 0,86 | 1,54 | 0,90 | 0,39 | -0,04 | -0,79 | -0,34 | -0,08 | 0,72 | 1,38 | 2,73 |
| IPCA + 5,44% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,28 | 0,97 | 1,43 | 1,34 | 1,61 | 1,68 | 1,38 | 1,22 | 16,02 |
| p.p. indexador | -1,49 | -2,23 | -0,56 | 0,81 | -0,38 | -0,59 | -1,47 | -2,13 | -1,95 | -1,75 | -0,65 | 0,16 | -13,30 |
| 2020 | 0,65 | -1,49 | -9,14 | 2,57 | 2,61 | 1,62 | 3,08 | -0,83 | -1,83 | -0,62 | 3,93 | 3,52 | 3,39 |
| IPCA + 5,88% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,88 | 0,72 | 1,12 | 1,34 | 1,35 | 1,86 | 10,64 |
| p.p. indexador | -0,06 | -2,15 | -9,71 | 2,43 | 2,54 | 0,89 | 2,20 | -1,55 | -2,95 | -1,96 | 2,58 | 1,66 | -7,25 |
| 2019 | 1,96 | 0,42 | 0,53 | 1,12 | 1,29 | 2,25 | 1,43 | 0,12 | 1,52 | 1,92 | -0,27 | 2,07 | 15,31 |
| 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 | 1,12 | -0,47 | -0,67 | 0,06 | 0,65 | 1,80 | 0,71 | -0,50 | 1,07 | 1,28 | -1,24 | 0,43 | 4,72 |

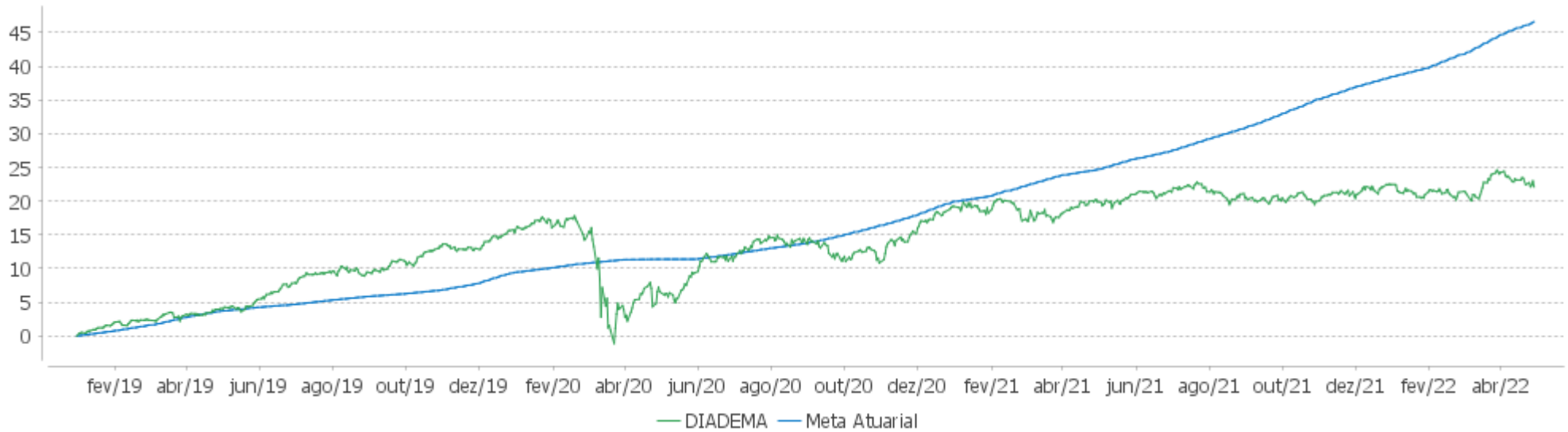
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 17 | 42,50 | 03 meses | 0,59 | 4,92 | -4,33 | 5,41 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 23 | 57,50 | 06 meses | 1,81 | 8,67 | -6,86 | 4,84 |
| | | | 12 meses | 1,83 | 18,01 | -16,17 | 4,47 |
| | | | 24 meses | 14,59 | 33,15 | -18,56 | 5,54 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,93 | 2020-11 | 36 meses | 17,31 | 44,51 | -27,20 | 8,28 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -9,14 | 2020-03 | Desde 31/12/2018 | 22,10 | 50,35 | -28,25 | 7,91 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

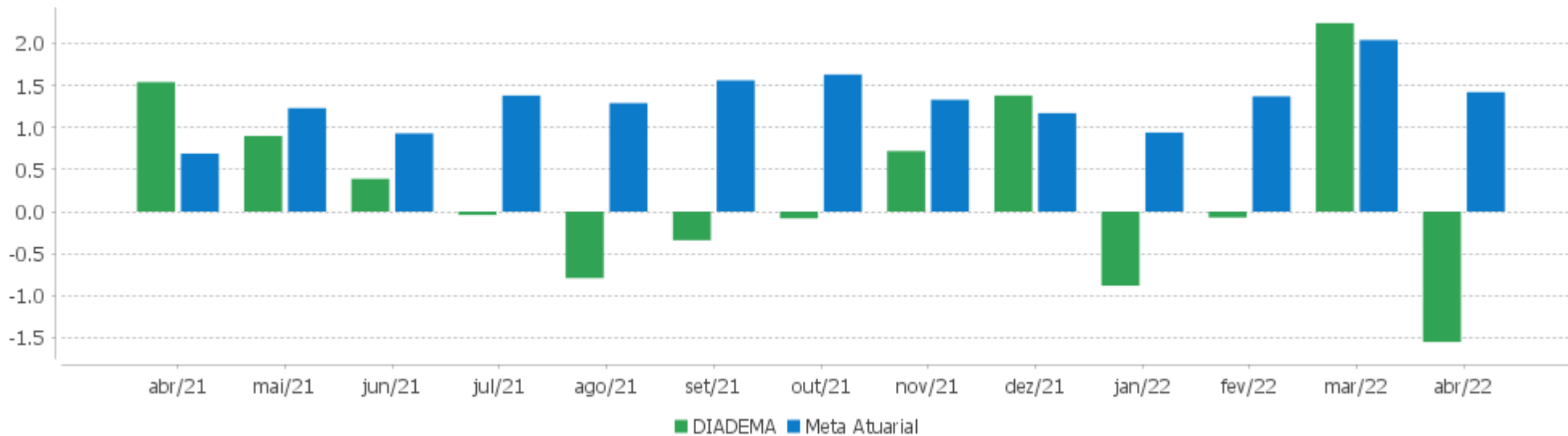


Patrimônio Líquido



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 |
|---|-----------------|----------------|----------------|-----------------|------------------|-----------------|-----------------|
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p. | 1,34 -0,16 | 5,15 -1,11 | 5,13 -0,06 | 8,90 -0,24 | 9,23 -9,61 | 18,72 -15,70 | 27,38 -18,55 |
| MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI | 0,90 108,11 | 3,64 111,05 | 2,84 112,17 | 5,23 111,79 | 8,73 123,29 | 15,10 161,02 | 13,88 92,13 |
| BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p. | 1,51 -0,05 | 5,24 -0,19 | 5,16 -0,15 | 8,67 -0,25 | 8,86 -0,59 | 17,72 -1,50 | 27,86 -1,69 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,78 93,74 | 3,37 102,74 | 2,57 101,47 | 4,85 103,71 | 7,39 104,48 | 9,81 104,61 | 14,81 98,27 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,80 95,90 | 3,38 102,94 | 2,57 101,59 | 4,80 102,68 | 7,48 105,64 | 9,87 105,22 | 14,77 98,03 |
| WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI | 0,68 82,10 | 3,24 98,80 | 2,44 96,58 | 4,63 99,04 | 7,32 103,39 | | |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 1,54 -0,02 | 5,36 -0,07 | 5,26 -0,06 | 8,80 -0,11 | 9,22 -0,23 | 18,69 -0,52 | 28,75 -0,80 |
| BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p. | 2,05 0,55 | 6,18 -0,09 | 5,58 0,39 | 8,66 -0,48 | 12,00 -6,83 | 22,58 -11,83 | 33,95 -11,98 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 1,48 -0,02 | 5,36 -0,09 | 5,35 -0,04 | 8,68 -0,31 | 9,34 0,07 | 19,39 -0,16 | 27,68 -2,17 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 1,40 -0,11 | 5,28 -0,17 | 5,26 -0,14 | 8,60 -0,39 | 9,10 -0,17 | 19,01 -0,54 | 27,75 -2,10 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 1,53 -0,03 | 5,32 -0,11 | 5,24 -0,07 | 8,75 -0,16 | 9,09 -0,36 | 18,51 -0,70 | 28,55 -0,99 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | -10,96 -0,86 | -2,16 -5,07 | -6,82 -3,02 | -9,35 -13,57 | -32,94 -23,67 | -4,49 -38,49 | -7,44 -19,40 |
| TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | -6,40 3,70 | 7,53 4,61 | 6,10 9,91 | 9,27 5,04 | 8,40 17,67 | 113,63 79,63 | |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | -9,97 0,13 | -3,41 -6,32 | -8,78 -4,98 | 6,35 2,12 | 7,43 16,70 | | |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p. | -5,92 4,18 | -0,02 -2,93 | -2,59 1,22 | -1,78 -6,00 | -15,20 -5,93 | 26,06 -7,94 | 25,60 13,64 |
| OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | -8,70 1,41 | 2,07 -0,85 | -4,18 -0,38 | 2,81 -1,42 | -11,58 -2,31 | 30,74 -3,26 | 20,13 8,17 |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I | -10,34 | -32,32 | -21,44 | -32,75 | -22,11 | 12,22 | 62,85 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Varição da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|--------------------|---------------------|---------------------|--------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,24 | -35,24 | -17,64 | -36,97 | -12,84 | -21,78 | 50,89 |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI | -8,78 -1.052,01 | -11,46 -349,41 | -6,59 -260,79 | -7,07 -151,07 | 4,33 61,13 | 49,35 526,26 | 46,68 309,81 |
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI | 0,19 23,28 | -49,41 -1.506,75 | -49,49 -1.957,27 | 108,10 2.310,74 | 80,94 1.143,66 | -99,36 -1.059,53 | -99,61 -661,03 |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p. | 0,82 -0,38 | 5,30 5,01 | 4,67 3,37 | 10,14 5,01 | 11,18 12,86 | 26,01 17,97 | 26,88 14,74 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p. | 1,30 11,41 | 0,95 -1,97 | 1,31 5,11 | 5,13 0,91 | 0,85 10,12 | 2,37 -31,63 | 4,17 -7,79 |
| DIADEMA Var. IPCA + 4,89% p.p. | -1,55 -2,97 | -0,30 -6,21 | 0,59 -4,33 | 1,81 -6,77 | 1,83 -15,76 | 14,59 -17,04 | 17,31 -24,10 |
| CDI | 0,83 | 3,28 | 2,53 | 4,68 | 7,08 | 9,38 | 15,07 |
| IBOVESPA | -10,10 | 2,91 | -3,81 | 4,23 | -9,27 | 34,00 | 11,96 |
| INPC + 6,00% | 1,48 | 6,47 | 5,25 | 9,23 | 19,19 | 35,86 | 47,59 |
| IPCA + 6,00% | 1,50 | 6,27 | 5,18 | 9,14 | 18,83 | 34,41 | 45,93 |

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 IPCA I | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,15 |
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | D+0 | D+0 | D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação) | D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação) | | 0,20 |
| BB PREV RF IDKA2 | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | D+1 du | D+0 | D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate) | D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate) | | 3,00 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA | D+1 du | D+0 | D+30 | D+2 | | |
| MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,45 |
| OCCAM FIC FIA | D+1 du | D+0 | D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate) | D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate) | - | 3,00 |
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,10 |
| TARPON GT 30 FIC FIA | D+1 du | D+1 du | D+30 | D+32 | O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|-----------|------------|-----------|------------|---|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| | | | | | de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro | |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+4 du | | 1,50 |
| WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,15 |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 1,00 |

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 | 0,75 | 3,04 | 2,40 | 4,76 | 5,63 | 8,09 | 15,23 | 22,93 | 33,92 |
| IRF-M 1+ | -0,53 | 0,26 | 0,76 | 4,79 | -1,08 | 0,34 | 14,30 | 26,22 | 44,13 |
| IRF-M TOTAL | -0,12 | 1,23 | 1,31 | 4,98 | 1,22 | 3,18 | 15,24 | 25,96 | 42,07 |
| IMA-B 5 | 1,56 | 5,43 | 5,31 | 8,92 | 9,45 | 19,21 | 29,55 | 42,42 | 59,01 |
| IMA-B 5+ | 0,08 | 1,99 | 3,65 | 6,19 | -0,03 | 10,27 | 19,61 | 43,70 | 58,71 |
| IMA-B TOTAL | 0,83 | 3,73 | 4,49 | 7,56 | 4,69 | 14,81 | 25,06 | 44,56 | 60,36 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,54 | 3,09 | 2,88 | 5,86 | 4,95 | 9,79 | 19,09 | 31,12 | 45,31 |
| IDKA 2 | 1,51 | 5,45 | 5,39 | 8,99 | 9,27 | 19,55 | 29,85 | 42,08 | 59,55 |
| IDKA 20 | -1,21 | -0,85 | 2,14 | 2,79 | -8,97 | 3,42 | 9,22 | 42,00 | 53,49 |
| CDI | 0,83 | 3,28 | 2,53 | 4,68 | 7,08 | 9,38 | 15,07 | 22,37 | 32,30 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -10,10 | 2,91 | -3,81 | 4,23 | -9,27 | 34,00 | 11,96 | 25,27 | 64,94 |
| IBRX 100 | -10,11 | 3,27 | -3,37 | 4,71 | -10,15 | 35,89 | 15,35 | 30,27 | 70,90 |
| IBRX 50 | -10,51 | 3,33 | -4,01 | 5,29 | -9,44 | 38,94 | 13,39 | 25,43 | 65,73 |
| SMALL CAP | -8,36 | -2,23 | -5,46 | -0,84 | -20,81 | 23,46 | 17,79 | 30,74 | 73,22 |
| IFIX | 1,19 | 0,29 | 1,30 | 5,13 | -1,68 | 8,04 | 12,14 | 20,36 | 38,18 |
| Índice Consumo - ICON | -14,19 | | -11,54 | -16,34 | -30,65 | -10,38 | -9,46 | -1,52 | 13,09 |
| Índice Dividendos - IDIV | -5,19 | 9,49 | 1,87 | 12,24 | 3,76 | 42,18 | 31,97 | 56,94 | 85,91 |

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 | 1,06 | 4,29 | 3,73 | 6,05 | 12,13 | 19,71 | 22,58 | 28,64 | 32,19 |
| INPC | 1,04 | 4,49 | 3,80 | 6,14 | 12,47 | 21,00 | 23,98 | 30,27 | 32,47 |
| IGPM | 1,41 | 6,98 | 5,07 | 7,93 | 14,66 | 51,37 | 61,49 | 75,44 | 78,75 |
| SELIC | 0,83 | 3,28 | 2,53 | 4,68 | 7,08 | 9,38 | 15,07 | 22,37 | 32,32 |

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 | -5,31 | -23,58 | -15,98 | -21,79 | -10,04 | 28,59 | 74,88 | 120,49 | 166,54 |
| MSCI ACWI | -4,62 | -23,67 | -16,34 | -23,54 | -15,21 | 21,12 | 55,29 | 81,22 | 120,87 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,36 | 5,62 | 4,71 | 8,12 | 16,60 | 29,42 | 37,85 | 50,40 | 60,68 |
| IPCA + 5,00% | 1,43 | 5,94 | 4,95 | 8,63 | 17,72 | 31,90 | 41,85 | 56,24 | 68,52 |
| IPCA + 5,50% | 1,47 | 6,10 | 5,07 | 8,89 | 18,27 | 33,16 | 43,88 | 59,23 | 72,55 |
| IPCA + 5,89% | 1,50 | 6,23 | 5,16 | 9,08 | 18,71 | 34,14 | 45,48 | 61,58 | 75,75 |
| IPCA + 6,00% | 1,50 | 6,27 | 5,18 | 9,14 | 18,83 | 34,41 | 45,93 | 62,25 | 76,66 |
| INPC + 4,00% | 1,34 | 5,82 | 4,77 | 8,21 | 16,95 | 30,82 | 39,42 | 52,30 | 61,02 |
| INPC + 6,00% | 1,48 | 6,47 | 5,25 | 9,23 | 19,19 | 35,86 | 47,59 | 64,31 | 77,03 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|--|----------------------|----------------------|--------------------|--------------|
| 948 | 05/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 40.000,00 | 16.173,37245200 | 2,4732009430 |
| 941 | 05/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.307.069,20 | 528.492,92480600 | 2,4732009430 |
| 949 | 07/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 15.000,00 | 6.060,53402500 | 2,4750294180 |
| 939 | 07/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 155.722,08 | 0,00 | 62.917,26428200 | 2,4750294180 |
| 942 | 07/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.385.692,68 | 559.869,17566400 | 2,4750294180 |
| 950 | 14/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 60.000,00 | 24.192,08281500 | 2,4801502400 |
| 943 | 14/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 7.347.814,62 | 2.962.648,99661900 | 2,4801502400 |
| 940 | 18/04/2022 | BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | 0,00 | 4.000.000,00 | 1.553.769,11762700 | 2,5743850580 |
| 944 | 18/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 4.000.000,00 | 0,00 | 1.612.175,69901800 | 2,4811191500 |
| 951 | 19/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 20.000,00 | 8.057,86532300 | 2,4820469440 |
| 945 | 20/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 6.259.920,74 | 0,00 | 2.521.157,40397800 | 2,4829551420 |
| 952 | 25/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 70.000,00 | 28.168,10006600 | 2,4850806350 |
| 946 | 28/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 6.469.940,29 | 0,00 | 2.600.210,94890200 | 2,4882366920 |
| 953 | 29/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 70.000,00 | 28.119,98849700 | 2,4893324550 |
| 947 | 29/04/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 5.851.634,75 | 2.350.684,31227300 | 2,4893324550 |
| Total | | | 16.885.583,11 | 20.167.211,25 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.448.587,89

Value-At-Risk: 2,29%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| DIADEMA | | 2,29 | 2,29 | | | 237.576.162,76 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,63%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF IDKA2 | | 1,11 | 0,04 | 0,21 | | | 17.691.477,61 | 7,45 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | | 1,02 | 0,05 | 0,02 | | | 24.891.921,26 | 10,48 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,17 | 0,03 | 0,23 | | | 16.070.216,03 | 6,76 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | | 1,03 | 0,01 | 0,03 | | | 4.343.010,22 | 1,83 |
| BB PREV IPCA I | | 0,63 | 0,00 | 0,60 | | | 17.837.090,40 | 7,51 |
| Sub-total | 1,91 | 0,92 | 0,13 | | 0,41 | 1,61 | 80.833.715,52 | 34,02 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | | 0,04 | -0,00 | 0,04 | | | 13.720.505,65 | 5,78 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | | 0,03 | 0,00 | 0,03 | | | 26.596.923,26 | 11,20 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | | 1,04 | 0,05 | 0,03 | | | 23.487.926,48 | 9,89 |
| WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC | | 0,04 | 0,00 | 0,04 | | | 15.884.343,87 | 6,69 |
| Sub-total | 0,67 | 0,31 | 0,05 | | 0,23 | 0,99 | 79.689.699,26 | 33,54 |

Artigo 7º V, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | | 1,24 | 0,02 | 1,22 | | | 7.053.829,80 | 2,97 |
| MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO | | 0,05 | 0,00 | 0,05 | | | 4.039.762,98 | 1,70 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| Sub-total | 1,87 | 0,79 | 0,02 | | 0,20 | 1,22 | 11.093.592,78 | 4,67 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,35%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | | 8,59 | 0,23 | 5,10 | | | 8.165.828,56 | 3,44 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | | 11,49 | 0,17 | 5,97 | | | 4.687.662,58 | 1,97 |
| OCCAM FIC FIA | | 8,31 | 0,18 | 2,81 | | | 7.525.274,48 | 3,17 |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA | | 10,68 | 0,12 | 5,79 | | | 3.630.846,67 | 1,53 |
| TARPON GT 30 FIC FIA | | 9,00 | 0,09 | 8,28 | | | 3.986.053,44 | 1,68 |
| Sub-total | 14,81 | 8,35 | 0,80 | | -0,61 | -8,15 | 27.995.665,73 | 11,78 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,92%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | | 9,93 | 0,81 | 9,93 | | | 21.274.543,44 | 8,95 |
| Sub-total | 27,25 | 9,93 | 0,81 | | -0,35 | -8,78 | 21.274.543,44 | 8,95 |

Artigo 10º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP | | 3,41 | 0,00 | 3,41 | | | 16.375,15 | 0,01 |
| Sub-total | 356,13 | 3,41 | 0,00 | | -0,00 | 0,19 | 16.375,15 | 0,01 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,41%

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|--------|---------------|------------|
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I | | 12,41 | 0,49 | 13,58 | | | 13.069.837,39 | 5,50 |
| Sub-total | 28,04 | 12,41 | 0,49 | | -0,40 | -10,34 | 13.069.837,39 | 5,50 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|-----------------------------|
| Sub-total | | | | | | | | |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | Value-At-Risk: 1,29% |
| Artigo 11º | | | | | | | | |
| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO | | 1,57 | -0,00 | 3,14 | | | 2.429.031,65 | 1,02 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 | | 2,66 | -0,00 | 9,57 | | | 1.173.701,84 | 0,49 |
| Sub-total | 2,45 | 1,29 | -0,00 | | 0,06 | 0,98 | 3.602.733,49 | 1,52 |