



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
3º TRIMESTRE 2020



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 30.09.2020.

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

90,73%

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|----------------------------------------|--------|-----------------------------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 12,79 | 0,55 | -1,53 | 0,89 | 58.613.629,17 | 15,89 | 5.834.527.804,73 | 1,00 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,53 | 0,03 | 0,13 | 0,47 | 39.321.890,68 | 10,66 | 10.130.144.603,43 | 0,39 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,01 | 0,23 | -0,16 | 1,21 | 27.797.568,56 | 7,53 | 17.747.142.317,32 | 0,16 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,74 | 0,80 | -2,64 | 0,65 | 6.261.160,38 | 1,70 | 1.755.979.575,38 | 0,36 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,08 | 0,22 | 0,04 | 1,66 | 23.566.393,65 | 6,39 | 9.208.011.978,57 | 0,26 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,98 | 0,25 | -0,61 | -0,30 | 48.052.039,76 | 13,02 | 11.234.342.142,99 | 0,43 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 6,22 | 0,28 | -0,75 | 0,10 | 20.220.685,98 | 5,48 | 10.452.752.168,75 | 0,19 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 5,95 | 0,24 | -0,50 | -0,09 | 65.652.659,06 | 17,79 | 13.535.810.678,86 | 0,49 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 8,72 | 0,25 | -0,77 | 0,74 | 9.092.700,00 | 2,46 | 175.099.648,53 | 5,19 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 7,32 | 0,29 | -0,62 | 0,46 | 298.578.727,24 | 80,93 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------------------|--------|-----------------------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,23 | -0,06 | -0,18 | 0,15 | 15.284.037,87 | 4,14 | 5.784.897.306,60 | 0,26 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,30 | -0,02 | -0,00 | 0,39 | 10.865.679,53 | 2,95 | 4.760.770.417,77 | 0,23 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 4,93 | 0,21 | -0,59 | -0,01 | 10.030.296,64 | 2,72 | 547.986.362,75 | 1,83 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,49 | 0,03 | -0,22 | 0,17 | 36.180.014,04 | 9,81 | | |
| Renda Fixa | | | 6,75 | 0,26 | -0,58 | 0,44 | 334.758.741,28 | 90,73 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

8,33%

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 60,10 | 2,22 | -8,11 | -9,58 | 1.219.455,40 | 0,33 | 472.017.380,08 | 0,26 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 44,35 | 1,22 | -4,45 | 2,15 | 4.476.265,94 | 1,21 | 844.202.491,55 | 0,53 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA CONSUMO | 45,71 | 1,72 | -4,06 | 1,41 | 1.433.606,73 | 0,39 | 718.937.900,79 | 0,20 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 39,13 | 0,08 | -4,93 | -0,96 | 3.457.468,69 | 0,94 | 783.577.685,83 | 0,44 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 47,79 | 1,41 | -5,93 | 1,37 | 1.558.858,12 | 0,42 | 1.156.431.775,09 | 0,13 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 41,71 | 1,94 | -4,00 | 3,54 | 2.819.361,92 | 0,76 | 1.846.376.502,59 | 0,15 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC | 43,48 | 0,74 | -4,96 | 2,00 | 3.943.640,61 | 1,07 | 3.159.975.144,49 | 0,12 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 44,55 | 0,90 | -5,38 | -0,22 | 3.721.702,08 | 1,01 | 829.854.206,90 | 0,45 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 49,54 | 1,09 | -4,98 | 0,61 | 22.630.359,49 | 6,13 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 7,75 | 0,24 | -0,91 | 0,35 | 4.597.112,49 | 1,25 | 5.019.584.079,54 | 0,09 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO | 1,73 | -0,09 | -0,45 | -0,37 | 3.516.560,93 | 0,95 | 505.717.833,93 | 0,70 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 5,07 | 0,10 | -0,71 | 0,03 | 8.113.673,42 | 2,20 | | |
| Renda Variável | | | 35,90 | 0,83 | -3,89 | 0,33 | 30.744.032,91 | 8,33 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,93%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|-------------------------------------|------------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 28,45 | 1,41 | -1,99 | 14,98 | 3.444.231,00 | 0,93 | 1.671.279.124,17 | 0,21 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 28,45 | 1,41 | -1,99 | 14,98 | 3.444.231,00 | 0,93 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 31,97 | 1,41 | -1,99 | 14,98 | 3.444.231,00 | 0,93 | | |
| Total | | | 8,44 | 0,31 | -0,87 | 0,45 | 368.947.005,19 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | Pró-Gestão Nível 2 | |
|----------------------------------|----------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 298.578.727,24 | 80,93 | 50,00 | 73,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 36.180.014,04 | 9,81 | 0,00 | 10,00 | 40,00 | 0,00 | 50,00 |
| | Total Renda Fixa | 334.758.741,28 | 90,73 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 22.630.359,49 | 6,13 | 0,00 | 8,00 | 15,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 8.113.673,42 | 2,20 | 0,00 | 5,00 | 5,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável | 30.744.032,91 | 8,33 | | | | | 40,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 3.444.231,00 | 0,93 | 0,00 | 0,50 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 3.444.231,00 | 0,93 | | | | | 10,00 |
| Total | | 368.947.005,19 | 100,00 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Trimestre (R\$) |
|----------------------------------------------|--------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----------|----------------------|---------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | -0,62 -394,23 | 0,46 90,25 | 0,46 90,25 | 3,91 310,56 | | -1.915.263,29 | 1.367.107,81 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | -0,22 -143,25 | 0,17 32,90 | 0,17 32,90 | 0,92 72,78 | | -78.925,87 | 51.680,98 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -4,98 -0,18 | 0,61 1,08 | 0,61 1,08 | 29,54 -0,02 | | -1.189.680,30 | -25.533,26 |
| Artigo 8º III % do CDI | -0,71 -451,93 | 0,03 6,80 | 0,03 6,80 | 3,30 262,72 | | -57.969,81 | 2.828,37 |
| Artigo 9º III % do CDI | -1,99 -1.270,48 | 14,98 2.920,27 | 14,98 2.920,27 | 43,04 3.422,32 | | -49.736,83 | 173.713,27 |
| TOLEDO (Total) | | | | | | -3.291.576,10 | 1.569.797,17 |

RESULTADO POR ATIVO

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------|---------------|-------------|----------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 20.374.010,51 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.220.685,98 | -153.324,53 | 21.060,38 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.163.392,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.092.700,00 | -70.692,00 | 70.096,07 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 23.557.742,15 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 23.566.393,65 | 8.651,50 | 385.863,37 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 27.841.918,14 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 27.797.568,56 | -44.349,58 | 331.714,43 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 6.431.135,41 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.261.160,38 | -169.975,03 | 40.459,58 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 59.526.357,42 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 58.613.629,17 | -912.728,25 | 519.038,37 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 39.632.731,28 | 3.991.786,14 | -4.358.021,91 | 0,00 | 39.321.890,68 | 55.395,17 | 204.870,30 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 48.348.272,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 48.052.039,76 | -296.232,91 | -146.494,28 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 65.984.666,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 65.652.659,06 | -332.007,66 | -59.500,41 |
| | | | | | 298.578.727,24 | 0,00 | 0,00 |

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 10.865.966,10 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.865.679,53 | -286,57 | 42.334,82 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 15.311.870,35 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.284.037,87 | -27.832,48 | 23.040,20 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 9.049.065,96 | 1.032.037,50 | 0,00 | 0,00 | 10.030.296,64 | -50.806,82 | -13.694,04 |
| | | | | | 36.180.014,04 | 0,00 | 0,00 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 4.684.604,57 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.476.265,94 | -208.338,63 | 94.280,24 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 1.327.015,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.219.455,40 | -107.559,80 | -129.249,66 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 1.494.230,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.433.606,73 | -60.623,94 | 19.972,29 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 1.657.069,21 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.558.858,12 | -98.211,09 | 21.134,36 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 3.636.641,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.457.468,69 | -179.173,19 | -33.385,33 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 3.566.173,99 | 367.949,92 | 0,00 | 0,00 | 3.721.702,08 | -212.421,83 | -71.086,38 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 4.149.507,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.943.640,61 | -205.866,44 | 77.398,12 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 2.936.847,30 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.819.361,92 | -117.485,38 | -4.596,90 |
| | | | | | 22.630.359,49 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 4.639.300,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.597.112,49 | -42.188,37 | 15.875,24 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO | 3.532.342,37 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.516.560,93 | -15.781,44 | -13.046,87 |
| | | | | | 8.113.673,42 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|-------------------------------------|----------------|--------------|----------|-------------|--------------|--------------------------------|--------------------------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 2.493.967,83 | 1.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 3.444.231,00 | -49.736,83 | 173.713,27 |
| | | | | | 3.444.231,00 | 0,00 | 0,00 |

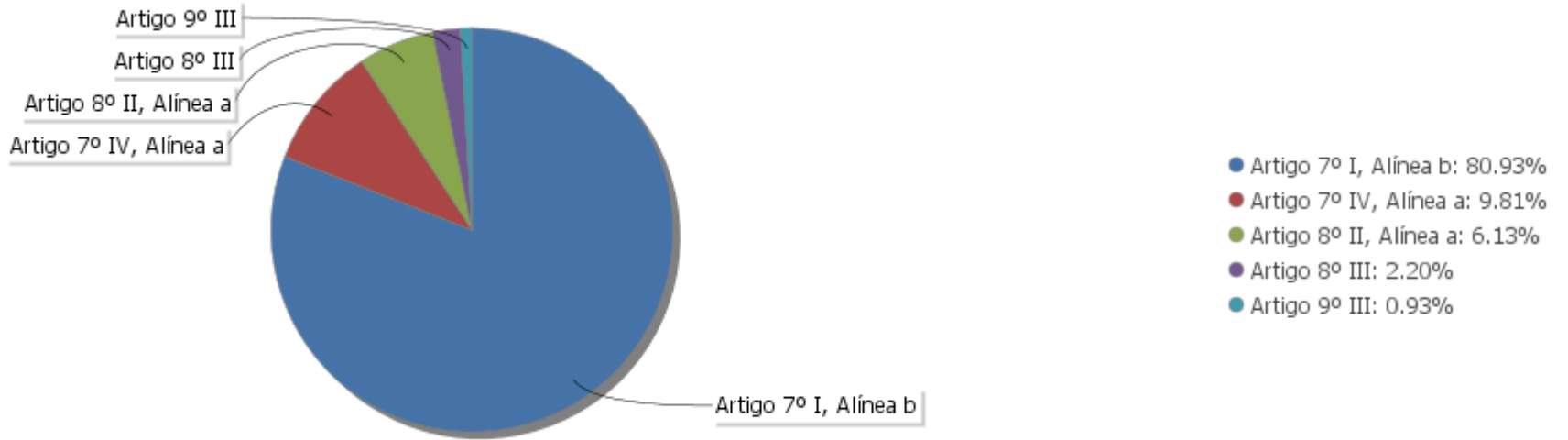
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

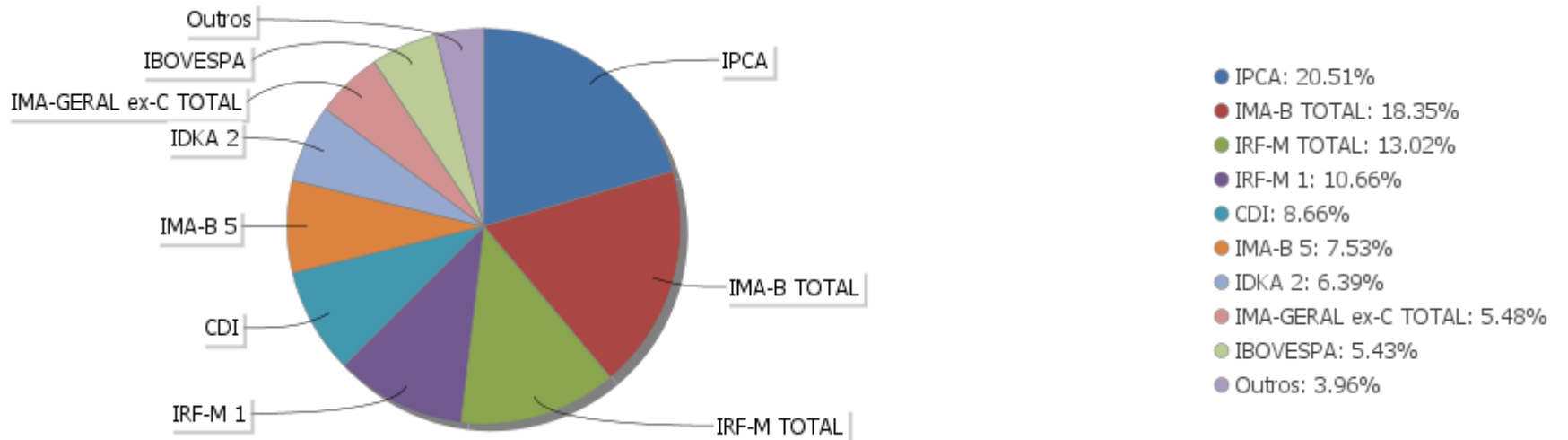
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo |
|-----------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|-------------------|
| de 0 a 30 dias | 341.435.865,95 | 92,54 | 341.435.865,95 | 92,54 | |
| de 31 dias a 365 dias | 18.418.439,24 | 4,99 | 359.854.305,19 | 97,54 | |
| acima de 365 dias | 9.092.700,00 | 2,46 | 368.947.005,19 | 100,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

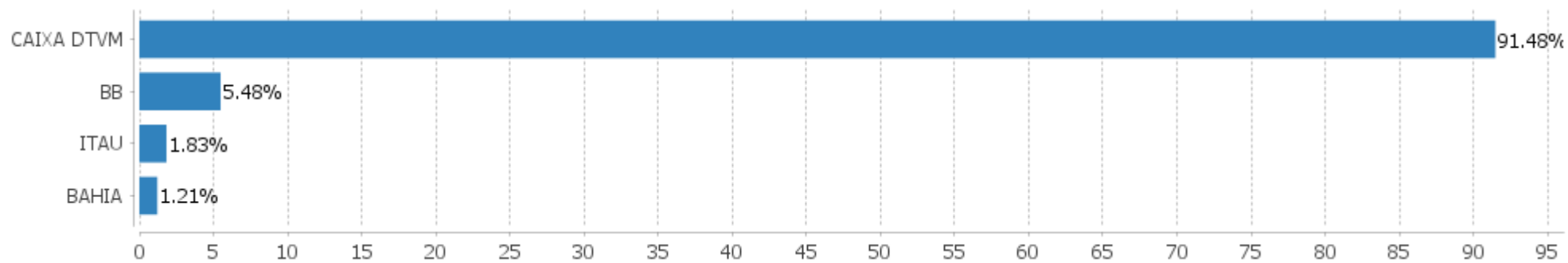


Alocação Por Estratégia



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 |
|----------------|-------|-------|-------|------|------|------|------|-------|-------|-----|-----|-----|-----------|
| 2020 | 0,52 | -0,14 | -3,86 | 1,35 | 1,57 | 1,44 | 1,98 | -0,63 | -0,87 | | | | 1,23 |
| INPC + 5,87% | 0,69 | 0,58 | 0,68 | 0,22 | 0,20 | 0,78 | 0,96 | 0,84 | 1,35 | | | | 6,48 |
| p.p. indexador | -0,17 | -0,72 | -4,54 | 1,12 | 1,37 | 0,66 | 1,02 | -1,47 | -2,22 | | | | -5,25 |

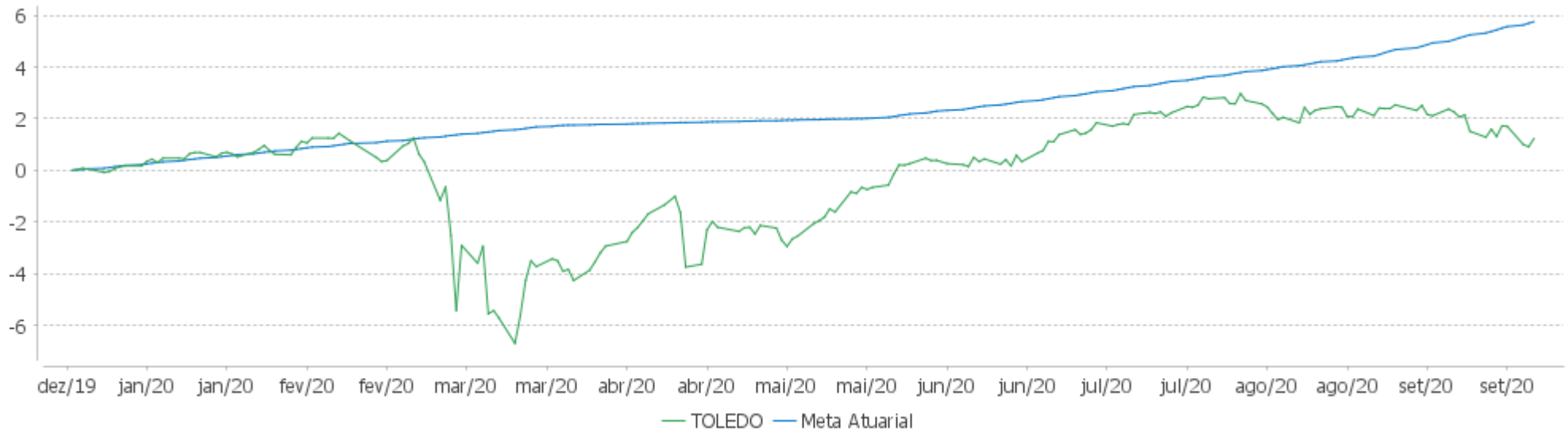
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

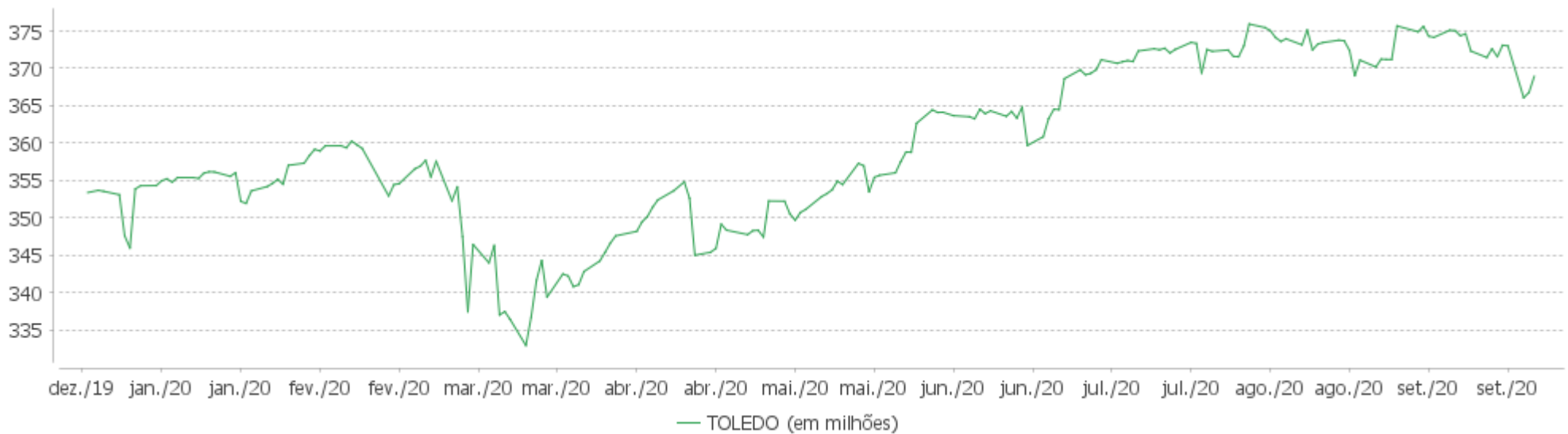
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 4 | 44,44 | 03 meses | 0,45 | 3,19 | -2,73 | 3,82 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 5 | 55,56 | 06 meses | 4,89 | 4,43 | 0,46 | 5,48 |
| | | | 12 meses | | | | |
| | | | 24 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 1,98 | 2020-07 | Desde 31/12/2019 | 1,23 | 6,48 | -5,25 | 8,44 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,86 | 2020-03 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

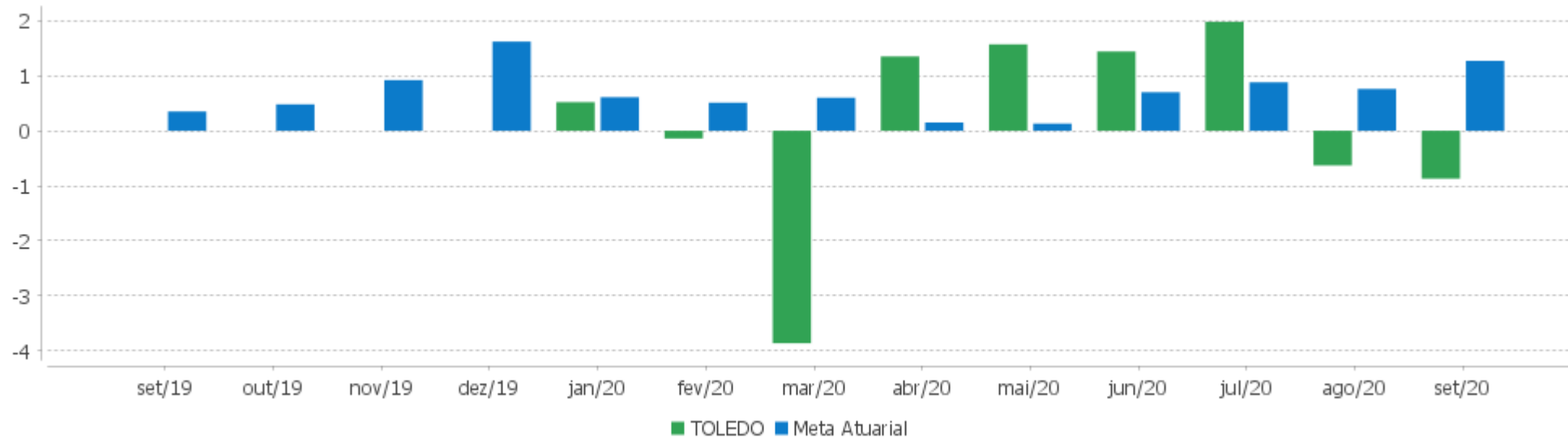


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,77 0,74 | 0,74 -0,22 | 0,74 -0,22 | 5,93 -0,04 | 7,64 5,53 | | |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | -1,53 -0,02 | 0,89 -0,07 | 0,89 -0,07 | 5,84 -0,12 | 1,68 -0,43 | 33,36 -0,78 | 36,41 -1,16 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | -0,16 -0,04 | 1,21 -0,09 | 1,21 -0,09 | 4,96 -0,15 | 6,91 -0,33 | 23,18 -0,58 | 30,91 -0,93 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | -0,75 -0,04 | 0,10 -0,15 | 0,10 -0,15 | 3,07 0,08 | 3,70 -0,19 | 21,50 0,39 | 27,56 0,18 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | -0,50 -1,14 | -0,09 -1,34 | -0,09 -1,34 | 3,18 2,37 | 6,41 3,27 | 25,88 19,76 | 33,17 22,25 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,04 0,02 | 1,66 -0,33 | 1,66 -0,33 | 5,27 -0,15 | 7,35 -0,65 | 20,53 -1,35 | 29,77 -2,49 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,13 -0,02 | 0,47 -0,04 | 0,47 -0,04 | 1,57 -0,10 | 4,34 -0,21 | 11,93 -0,39 | 19,28 -0,63 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p. | -0,61 -0,05 | -0,30 -0,07 | -0,30 -0,07 | 3,01 -0,13 | 6,31 -0,25 | 24,12 -0,38 | 30,74 -0,90 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | -2,64 -0,04 | 0,65 -0,10 | 0,65 -0,10 | 6,56 -0,22 | -2,10 -0,43 | 40,97 -1,45 | 39,57 -1,69 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | -0,00 -1,68 | 0,39 76,24 | 0,39 76,24 | 0,97 77,04 | 2,90 81,49 | 9,20 91,50 | 16,28 93,61 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI | -0,18 -115,80 | 0,15 29,43 | 0,15 29,43 | 0,94 74,45 | 3,21 90,26 | 9,64 95,81 | 16,69 96,01 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p. | -0,59 -1,23 | -0,01 -1,25 | -0,01 -1,25 | | | | |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p. | -0,45 4,35 | -0,37 0,11 | -0,37 0,11 | 0,25 -29,31 | 2,97 12,65 | 15,39 -3,84 | |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI | -0,91 -579,32 | 0,35 67,54 | 0,35 67,54 | 5,77 458,58 | 3,05 85,77 | 22,65 225,22 | 30,42 174,96 |
| FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p. | -4,06 -0,10 | 1,41 -0,42 | 1,41 -0,42 | 40,64 -1,37 | -1,18 -0,14 | 50,69 -2,34 | 22,40 -5,50 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p. | -4,00 0,80 | 3,54 4,01 | 3,54 4,01 | 35,88 6,32 | -0,77 8,92 | 43,28 24,04 | 50,76 23,42 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | -5,93 | 1,37 | 1,37 | 33,48 | -4,18 | 45,25 | 33,42 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|----------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|-------------------|-----------------|-----------------|
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,13 | 1,85 | 1,85 | 3,92 | 5,51 | 26,01 | 6,08 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p. | -4,45 0,35 | 2,15 2,63 | 2,15 2,63 | 31,96 2,40 | -5,14 4,54 | 23,13 3,89 | 36,96 9,62 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI | -8,11 -5.163,62 | -9,58 -1.867,91 | -9,58 -1.867,91 | 15,62 1.242,44 | -21,21 -596,29 | 39,66 394,33 | 9,57 55,04 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p. | -4,96 -0,17 | 2,00 2,48 | 2,00 2,48 | 30,39 0,83 | -10,53 -0,85 | 31,29 12,06 | 43,75 16,41 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -4,93 -0,30 | -0,96 2,35 | -0,96 2,35 | 19,42 4,64 | -6,98 2,83 | 43,54 5,70 | 33,91 3,42 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p. | -5,38 -0,58 | -0,22 0,25 | -0,22 0,25 | 32,92 3,37 | -2,46 7,23 | | |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p. | -1,99 -0,02 | 14,98 0,64 | 14,98 0,64 | 43,04 0,02 | 61,21 0,92 | 70,33 0,05 | 154,87 -5,51 |
| TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p. | -0,87 -2,22 | 0,45 -2,73 | 0,45 -2,73 | 4,89 0,46 | | | |
| CDI | 0,16 | 0,51 | 0,51 | 1,26 | 3,56 | 10,06 | 17,39 |
| IBOVESPA | -4,80 | -0,48 | -0,48 | 29,56 | -9,68 | 19,23 | 27,34 |
| INPC + 6,00% | 1,36 | 3,22 | 3,22 | 4,50 | 10,12 | 20,11 | 32,29 |
| IPCA + 6,00% | 1,13 | 2,78 | 2,78 | 3,79 | 9,32 | 19,21 | 31,99 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|-----------------------------------------------------|-----------|------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|-------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | D+1 du | D+0 | D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate) | D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate) | - | 1,90 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | D+0 | D+0 | D+3 du | D+3 du | | 0,30 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 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 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 2,00 |
| FIA CAIXA CONSUMO | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,60 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 0,70 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 0,50 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO | D+0 | D+0 | D+0 | D+2 du | 0,00 | 1,60 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,40 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | D+0 | D+0 | | D +1 | | |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | D+1 du | D+0 | D+30 du | D+32 du | | 1,72 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | D+1 du | D+0 | D+23 du | D+25 du | | 1,50 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | D+0 | D+0 | D+21 du | D+23 du | | 1,90 |

O ADMINISTRADOR RECEBERÁ

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|------------------------------|-----------|------------|-----------|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | D+0 | D+0 | D+21 du | D+23 du | <p>TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA</p> <p>O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA DE UM DIA, APURADO PELA B3</p> | 2,50 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 0,15 | 0,51 | 0,51 | 1,66 | 4,54 | 12,32 | 19,91 | 35,08 | 55,52 |
| IRF-M 1+ | -0,91 | -0,59 | -0,59 | 3,90 | 7,61 | 30,00 | 36,94 | 63,26 | 107,88 |
| IRF-M TOTAL | -0,56 | -0,24 | -0,24 | 3,15 | 6,56 | 24,50 | 31,64 | 54,61 | 88,92 |
| IMA-B 5 | -0,12 | 1,30 | 1,30 | 5,11 | 7,24 | 23,75 | 31,84 | 49,57 | 77,74 |
| IMA-B 5+ | -2,60 | 0,75 | 0,75 | 6,78 | -1,67 | 42,42 | 41,26 | 65,69 | 123,18 |
| IMA-B TOTAL | -1,51 | 0,96 | 0,96 | 5,97 | 2,11 | 34,14 | 37,56 | 59,25 | 104,41 |
| IMA-GERAL TOTAL | -0,60 | 0,53 | 0,53 | 3,43 | 4,35 | 21,85 | 28,42 | 47,44 | 79,98 |
| IDKA 2 | 0,02 | 1,99 | 1,99 | 5,41 | 8,00 | 21,88 | 32,26 | 50,33 | 78,04 |
| IDKA 20 | -4,30 | 0,58 | 0,58 | 7,11 | -8,89 | 56,79 | 46,43 | 76,85 | 176,44 |
| CDI | 0,16 | 0,51 | 0,51 | 1,26 | 3,56 | 10,06 | 17,39 | 30,94 | 49,45 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -4,80 | -0,48 | -0,48 | 29,56 | -9,68 | 19,23 | 27,34 | 62,08 | 109,95 |
| IBRX 100 | -4,58 | -0,04 | -0,04 | 30,33 | -8,59 | 23,26 | 30,47 | 66,26 | 112,57 |
| IBRX 50 | -4,62 | -0,37 | -0,37 | 31,30 | -10,02 | 16,09 | 24,57 | 58,13 | 99,89 |
| SMALL CAP | -5,44 | 2,27 | 2,27 | 35,50 | -1,78 | 54,49 | 42,68 | 101,86 | 167,19 |
| Índice Consumo - ICON | -3,96 | 1,83 | 1,83 | 42,00 | -1,04 | 53,03 | 27,90 | 53,75 | 79,98 |
| Índice Dividendos - IDIV | -4,63 | -3,31 | -3,31 | 14,78 | -9,81 | 37,85 | 30,49 | 85,32 | 152,90 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | -0,95 | 11,74 | 11,74 | 41,18 | 53,03 | 62,59 | 137,68 | 169,51 | 148,68 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | 0,46 | -0,41 | -0,41 | 12,06 | 4,12 | 30,92 | 25,84 | 53,90 | 99,57 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | -0,38 | 10,90 | 10,90 | 38,62 | 47,03 | 51,87 | 106,68 | 134,69 | 110,24 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,64 | 1,24 | 1,24 | 0,81 | 3,14 | 6,12 | 10,92 | 13,74 | 23,38 |
| INPC | 0,87 | 1,68 | 1,68 | 1,49 | 3,89 | 6,93 | 11,17 | 12,99 | 23,33 |
| IGPM | 4,34 | 9,59 | 9,59 | 12,51 | 17,94 | 21,91 | 34,14 | 32,20 | 46,30 |
| SELIC | 0,16 | 0,51 | 0,51 | 1,26 | 3,56 | 10,06 | 17,40 | 30,98 | 49,51 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,97 | 2,27 | 2,27 | 2,81 | 7,26 | 14,76 | 24,69 | 32,93 | 49,97 |
| IPCA + 5,00% | 1,05 | 2,53 | 2,53 | 3,30 | 8,29 | 16,97 | 28,31 | 38,09 | 57,28 |
| IPCA + 5,50% | 1,09 | 2,65 | 2,65 | 3,54 | 8,81 | 18,09 | 30,14 | 40,72 | 61,04 |
| IPCA + 5,89% | 1,12 | 2,75 | 2,75 | 3,74 | 9,21 | 18,96 | 31,58 | 42,80 | 64,03 |
| IPCA + 6,00% | 1,13 | 2,78 | 2,78 | 3,79 | 9,32 | 19,21 | 31,99 | 43,39 | 64,88 |
| INPC + 4,00% | 1,20 | 2,71 | 2,71 | 3,50 | 8,04 | 15,63 | 24,98 | 32,05 | 49,91 |
| INPC + 6,00% | 1,36 | 3,22 | 3,22 | 4,50 | 10,12 | 20,11 | 32,29 | 42,44 | 64,81 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---------------------------------------------|----------------------|----------------------|--------------------|------------------|
| 47 | 03/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.664.582,79 | 0,00 | 1.417.863,39449200 | 2,5845810000 |
| 48 | 03/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 500.000,00 | 193.454,95404900 | 2,5845810000 |
| 49 | 06/07/2020 | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 500.000,00 | 0,00 | 108.791,24656926 | 4,5959580000 |
| 50 | 10/07/2020 | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 364.564,57 | 0,00 | 325.614,55672400 | 1,1196200000 |
| 51 | 29/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 4.270.891,41 | 1.649.282,56211900 | 2,5895450000 |
| 52 | 30/07/2020 | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 1.032.037,49 | 0,00 | 1.002,39928300 | 1.029,5672660000 |
| 53 | 30/07/2020 | ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 1.000.000,00 | 0,00 | 37.867,70870523 | 26,4077240000 |
| 54 | 07/08/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.901.342,38 | 0,00 | 1.505.242,76227300 | 2,5918360000 |
| 55 | 13/08/2020 | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 367.820,74 | 0,00 | 328.155,00390300 | 1,1208750000 |
| 56 | 19/08/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.675.341,30 | 646.202,22260100 | 2,5925960000 |
| 57 | 20/08/2020 | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 210.766,07 | 0,00 | 205,35275300 | 1.026,3610600000 |
| 58 | 27/08/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 4.344.324,63 | 1.675.826,17621300 | 2,5923480000 |
| 59 | 27/08/2020 | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 1.032.037,51 | 0,00 | 1.007,40381600 | 1.024,4526510000 |
| 60 | 28/08/2020 | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 1.000.000,00 | 0,00 | 191.979,33380867 | 5,2088940000 |
| 61 | 04/09/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.991.786,14 | 0,00 | 1.538.602,66425300 | 2,5944230000 |
| 62 | 15/09/2020 | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 367.949,92 | 0,00 | 330.075,71245000 | 1,1147440000 |
| 63 | 28/09/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 4.358.021,91 | 1.678.680,93970900 | 2,5960990000 |
| 64 | 29/09/2020 | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 1.032.037,50 | 0,00 | 1.013,87008600 | 1.017,9188770000 |
| 65 | 30/09/2020 | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 1.000.000,00 | 0,00 | 193.015,50242610 | 5,1809310000 |
| Total | | | 19.464.925,11 | 15.148.579,25 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.822.739,95

Value-At-Risk: 1,85%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | | 1,85 | 1,85 | | | 368.947.005,19 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,40%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-----------------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 3,24 | 0,48 | 0,02 | | | 58.613.629,17 | 15,89 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | | 0,14 | 0,01 | 0,01 | | | 39.321.890,68 | 10,66 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,02 | 0,06 | 0,01 | | | 27.797.568,56 | 7,53 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 5,13 | 0,08 | 0,09 | | | 6.261.160,38 | 1,70 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,03 | 0,05 | 0,36 | | | 23.566.393,65 | 6,39 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,39 | 0,16 | 0,02 | | | 48.052.039,76 | 13,02 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | | 1,43 | 0,07 | 0,15 | | | 20.220.685,98 | 5,48 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | | 1,33 | 0,22 | 1,35 | | | 65.652.659,06 | 17,79 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | | 1,83 | 0,04 | 1,94 | | | 9.092.700,00 | 2,46 |
| Sub-total | 4,26 | 1,53 | 1,17 | | -0,18 | -0,62 | 298.578.727,24 | 80,93 |

Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-----------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 0,11 | 0,00 | 0,10 | | | 15.284.037,87 | 4,14 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | | 0,08 | 0,00 | 0,08 | | | 10.865.679,53 | 2,95 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | | 1,25 | 0,03 | 1,27 | | | 10.030.296,64 | 2,72 |
| Sub-total | 0,99 | 0,39 | 0,03 | | -0,38 | -0,22 | 36.180.014,04 | 9,81 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,05%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | | 19,03 | 0,05 | 19,03 | | | 1.219.455,40 | 0,33 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | | 12,50 | 0,13 | 2,64 | | | 4.476.265,94 | 1,21 |
| FIA CAIXA CONSUMO | | 11,82 | 0,04 | 0,15 | | | 1.433.606,73 | 0,39 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | | 10,57 | 0,08 | 4,54 | | | 3.457.468,69 | 0,94 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | | 15,77 | 0,05 | 7,41 | | | 1.558.858,12 | 0,42 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | | 11,69 | 0,08 | 4,66 | | | 2.819.361,92 | 0,76 |
| ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC | | 12,64 | 0,11 | 4,15 | | | 3.943.640,61 | 1,07 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | | 11,08 | 0,09 | 2,85 | | | 3.721.702,08 | 1,01 |
| Sub-total | 22,16 | 11,97 | 0,63 | | -0,23 | -4,98 | 22.630.359,49 | 6,13 |

Artigo 8º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP | | 1,62 | 0,02 | 1,62 | | | 4.597.112,49 | 1,25 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO | | 0,16 | 0,00 | 11,54 | | | 3.516.560,93 | 0,95 |
| Sub-total | 2,26 | 0,94 | 0,02 | | -0,38 | -0,71 | 8.113.673,42 | 2,20 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,73%

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | | 12,73 | -0,01 | 1,77 | | | 3.444.231,00 | 0,93 |
| Sub-total | 32,97 | 12,73 | -0,01 | | -0,07 | -1,99 | 3.444.231,00 | 0,93 |