

## Comitê de Investimentos

**Ata nº 48/2021** – aos vinte dias do mês de outubro do ano de dois mil e vinte e um, às 9 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes - Presidente do Comitê**, **Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê**, **Clayton Faria Schmidt**, **Patrícia Ramos Quaresma**, **Victor Mendes Neto** e o **Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do BERTPREV**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM mercedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 18/10/2021:

| COPOM            | Referência          | Exercício | Situação | Anterior | Atual |
|------------------|---------------------|-----------|----------|----------|-------|
| Taxa Selic Atual | 02/08/21 a 22/09/21 | 2021      | Elevação | 5,25%    | 6,25% |

Fonte: Banco Central do Brasil

| Índice                                  | Referência       | Exercício | Situação | Previsão |       |
|-----------------------------------------|------------------|-----------|----------|----------|-------|
|                                         |                  |           |          | Anterior | Atual |
| Meta Taxa Selic (final de período)      | Mediana agregada | 2021      | Estável  | 8,25     | 8,25  |
| PIB                                     | Mediana agregada | 2021      | Redução  | 5,04     | 5,01  |
| Cotação do Dólar (final do período)     | Mediana agregada | 2021      | Estável  | 5,25     | 5,25  |
| IPCA (Expectativas - Curto Prazo)       | Mediana agregada | 2021      | Elevação | 8,59     | 8,69  |
| Dívida Líquida do Setor Público (% PIB) | Mediana agregada | 2021      | Redução  | 60,90    | 60,60 |
| Resultado Primário (% PIB)              | Mediana agregada | 2021      | Estável  | -1,40    | -1,40 |

|                                        |                     |      |          |        |        |
|----------------------------------------|---------------------|------|----------|--------|--------|
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8316 d.u. - 2054) | Anbima – 19/10/2021 | 2021 | Elevação | 5,1889 | 5,3996 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051) | Anbima – 19/10/2021 | 2021 | Elevação | 5,1812 | 5,3779 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041) | Anbima – 19/10/2021 | 2021 | Elevação | 5,1392 | 5,2893 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031) | Anbima – 19/10/2021 | 2021 | Elevação | 5,0129 | 5,1792 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026) | Anbima – 19/10/2021 | 2021 | Elevação | 4,7608 | 5,0564 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)  | Anbima – 19/10/2021 | 2021 | Elevação | 4,0517 | 4,5202 |

|                          |            |      |          |         |         |
|--------------------------|------------|------|----------|---------|---------|
| Ibovespa                 | 11/10/2021 | 2021 | Elevação | 110.123 | 110.672 |
| Risco Brasil (JP Morgan) | 18/10/2021 | 2021 | Redução  | 334     | 327     |

Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.

| Posição dos Investimentos | Agosto/21-Setembro/21 | 2021 | em Mil | Fechamento Agosto | Fechamento Setembro |
|---------------------------|-----------------------|------|--------|-------------------|---------------------|
|                           |                       |      |        | 650.921           | 635.280             |

A expectativa da Selic meta ao final deste exercício segue estimada em 8,25%. Os diferentes vértices da ETTJ já precificaram o patamar estimado para a elevação da taxa SELIC, e permanecem em alta desde o último mês em função das expectativas acerca da redução dos estímulos financeiros e da elevação dos juros nos Estados Unidos. Uma elevação mais significativa nas curvas de juros poderá ocorrer em função de reavaliação da trajetória da dívida pública atualmente suavizada em razão do incremento das receitas causado pelo ciclo





*Instituto de Previdência Social dos Servidores  
Públicos do Município de Bertioga*  
ESTADO DE SÃO PAULO

inflacionário, e também por conta de redução na política de estímulos monetários praticada pelos bancos centrais das principais economias mundiais. Nesta última semana a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, com impacto patrimonial negativo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado. O risco Brasil teve redução; no IBOVESPA houve elevação para 110.672 pontos, o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial positiva. Acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Mensal da LDB referente a competência de setembro/2021 com o patrimônio de R\$ 635.280M, o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 14/10/2021 com o patrimônio de R\$ 640.471M. Em razão da reunião do COPOM e alteração do calendário municipal, a reunião da próxima semana será realizada no dia 28/10/2021. Foram emitidas as seguintes APRs.

| APR     | Data da Operação | Movimento R\$ | Aplicação/Resgate | Produto                                              |
|---------|------------------|---------------|-------------------|------------------------------------------------------|
| 96/2021 | 22/10/2021       | 150.000,00    | Resgate           | SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI |
| 97/2021 | 27/10/2021       | 2.340.000,00  | Resgate           | SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI |
| 98/2021 | 22/10/2021       | 35.000,00     | Resgate           | SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI |

Nada mais, foi encerrada a reunião às 16:40 horas, e lavrada em ata.

**Clayton Faria Schmidt**

**Evanilson Fischer Matos Siqueira**

**Roberto Cassiano Guedes**

**Patrícia Ramos Quaresma**

**Victor Mendes Neto**

**Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade**





\*

14/10/2021

| CNPJ               | Fundo                                                    | Posição<br>8/10/2021 | Posição<br>14/10/2021 | Variação<br>Semanal | % PL    | Limite %<br>Res. 4604/17<br>Res. 4695/18 | Limite %<br>Pré-Gestão<br>Nível II | Saldo Dez/20<br>Evolução PL | R\$ 632.604.044,97<br>R\$ 7.867.712,34 | 9,90%<br>1,24% |
|--------------------|----------------------------------------------------------|----------------------|-----------------------|---------------------|---------|------------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------|----------------------------------------|----------------|
| XXX XXX XXX        | TOTAL PATRIMÔNIO                                         | 640.452.485,19       | 640.471.757,31        | 0,00%               | 100,00% |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | (*) CONTA TRANSITÓRIA                                    |                      |                       |                     | 0,000%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | Titulos Públicos Federal                                 | 164.414.486,47       | 163.848.724,25        | -0,34%              | 25,58%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| CP 0184            | CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)                                  | 164.414.486,47       | 163.848.724,25        | -0,34%              | 25,58%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | Fundos 100% Titulos Públicos                             | 65.036.145,39        | 65.007.374,50         | -0,04%              | 10,15%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 15.486.093/0001-83 | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI            | 17.043.912,37        | 17.054.551,09         | 0,06%               | 2,663%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 19.523.305/0001-06 | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI                       | 5.814.888,45         | 5.811.463,73          | -0,06%              | 0,907%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 19.769.046/0001-06 | CAIXA BRASIL 2030 II TP                                  | 16.221.725,20        | 16.177.546,80         | -0,27%              | 2,526%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 22.791.074/0001-26 | CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF                               | 19.831.747,00        | 19.841.549,00         | 0,05%               | 3,098%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 19.303.795/0001-35 | BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI                         | 6.123.872,37         | 6.122.263,88          | -0,03%              | 0,956%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | Fundos Referenciados Renda Fixa                          | 201.864.138,36       | 201.887.922,58        | 0,01%               | 31,52%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 09.577.447/0001-00 | SANTANDER DI TITULOS PUBLI PREMIUM*                      | 57.214.143,36        | 57.214.143,36         | 0,00%               | 8,933%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 21.838.150/0001-49 | ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI        | 104.320.736,11       | 104.362.826,57        | 0,04%               | 16,295% |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 28.515.874/0001-09 | BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA             | 40.329.258,89        | 40.310.952,65         | -0,05%              | 6,294%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | FI Renda Fixa Crédito Privado                            | 4.247.600,96         | 4.247.016,19          | -0,01%              | 0,66%   |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 14.091.645/0001-91 | BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI         | 4.247.600,96         | 4.247.016,19          | -0,01%              | 0,663%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | Fundos de Investimentos em Ações                         | 143.989.438,31       | 144.083.510,22        | 0,07%               | 22,50%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 07.279.657/0001-89 | QUEST AÇÕES FIC FIA                                      | 20.337.156,51        | 20.481.457,38         | 0,71%               | 3,198%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 11.392.165/0001-72 | QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES                               | 19.892.219,46        | 20.011.595,81         | 0,60%               | 3,125%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 09.290.813/0001-38 | BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA                           | 7.272.826,11         | 7.277.048,98          | 0,06%               | 1,136%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 11.977.794/0001-64 | BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA                        | 43.543.305,99        | 43.222.747,02         | -0,74%              | 6,749%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 08.817.414/0001-10 | ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI                 | 41.250.562,83        | 41.366.364,89         | 0,28%               | 6,459%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 09.087.523/0001-91 | WESTERN ASSET VALUATION FIA                              | 7.932.161,59         | 7.927.990,45          | -0,05%              | 1,238%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 15.154.441/0001-15 | CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES           | 3.761.205,82         | 3.796.305,69          | 0,93%               | 0,593%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | Fundos de Investimento em Participações                  | 23.274.048,18        | 23.274.048,20         | 0,00%               | 3,63%   |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 16.437.148/0001-28 | FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II          | 5.034.278,92         | 5.034.278,93          | 0,00%               | 0,786%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 27.782.774/0001-78 | KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N     | 18.239.769,26        | 18.239.769,27         | 0,00%               | 2,848%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | Fundos de Investimentos no Exterior                      | 26.478.007,47        | 26.834.468,08         | 1,35%               | 4,19%   |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 33.913.562/0001-85 | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIO | 10.648.235,07        | 10.772.501,41         | 1,17%               | 1,682%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 17.804.792/0001-50 | SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT. INVEST. NO EXTERIOR   | 10.542.712,18        | 10.706.031,88         | 1,55%               | 1,672%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 31.964.961/0001-40 | BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI    | 5.287.060,22         | 5.355.934,79          | 1,30%               | 0,836%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
|                    | Fundos de Investimentos no Exterior                      | 11.148.620,05        | 11.288.693,29         | 1,26%               | 1,76%   |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 19.436.818/0001-80 | SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB               | 5.524.266,62         | 5.591.219,61          | 1,21%               | 0,873%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |
| 17.502.937/0001-68 | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                      | 5.624.353,43         | 5.697.473,68          | 1,30%               | 0,890%  |                                          |                                    |                             |                                        |                |

(\*) ANTIGO SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI

*Katia Hidalgo Data*  
Coord. Adm. Financeira  
Reg.: 002 - BERTPREV



| CNPJ                                                                | Fundo                                                        | Patrimônio     | % PL    | CVM Limites %<br>Res. 3922/10 | Limite %<br>Pró-Gestão | Saldo Dez/20<br>Evolução PL            | R\$ 632.604.044,97<br>R\$ 2.675.997,36 | 9,90%<br>0,42%                 |
|---------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|---------|-------------------------------|------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|--------------------------------|
|                                                                     |                                                              |                |         | Res. 4604/17<br>Res. 4695/18  | Nível II               | Evolução PL Acumulada - Saldo Anterior |                                        | 1,56%                          |
| <b>TOTAL PATRIMÔNIO</b>                                             |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| XXX XXX XXX                                                         | (*) CONTA TRANSITÓRIA                                        | 635.280.042,33 | 100,0%  |                               |                        |                                        |                                        | Enquadramento                  |
| CP 0184                                                             | Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)                    | 163.725.321,52 | 25,77%  | 100,00%                       | 100,00%                | 10,00%                                 | 26,00%                                 | Artigo 7, Inciso I, Alínea A   |
|                                                                     | CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)                                      | 163.725.321,52 | 25,77%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
|                                                                     | Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos              | 64.728.777,21  | 10,19%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
|                                                                     | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI                | 16.953.659,09  | 2,669%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
|                                                                     | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI         | 5.795.005,20   | 0,912%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 15.486.093/0001-83                                                  | BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                   | -              | 0,000%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 19.523.305/0001-06                                                  | FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF                                | 16.160.241,60  | 2,544%  | 100,00%                       | 100,00%                | 10,00%                                 | 10,50%                                 | Artigo 7, Inciso I, Alínea B   |
| 25.078.994/0001-90                                                  | FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF                                | 19.720.961,00  | 3,104%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 19.769.046/0001-06                                                  | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI            | 6.098.910,32   | 0,960%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 22.791.074/0001-26                                                  |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 19.303.795/0001-35                                                  |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| <b>Fundos Renda Fixa em geral</b>                                   |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 09.577.447/0001-00                                                  | SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI                        | 198.342.773,88 | 31,22%  |                               |                        | 0,00%                                  | 26,00%                                 | Artigo 7, Inciso IV, Alínea A  |
| 21.838.150/0001-49                                                  | ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI            | 54.170.907,45  | 8,527%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 28.515.874/0001-09                                                  | BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA                 | 104.013.567,18 | 16,373% | 40,00%                        | 50,00%                 |                                        |                                        |                                |
|                                                                     |                                                              | 40.158.299,25  | 6,321%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| <b>FI Renda Fixa "Crédito Privado"</b>                              |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 14.091.645/0001-91                                                  | BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI             | 4.224.662,25   | 0,67%   | 5,00%                         | 15,00%                 | 0,00%                                  | 0,70%                                  | Artigo 7, Inciso VII, Alínea B |
|                                                                     |                                                              | 4.224.662,25   | 0,665%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| <b>Fundos de Investimentos de Ações em geral</b>                    |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 07.279.657/0001-89                                                  | QUEST AÇÕES FIC FIA                                          | 144.269.144,51 | 22,71%  |                               |                        | 0,00%                                  | 26,00%                                 | Artigo 8, Inciso II, Alínea A  |
| 11.392.165/0001-72                                                  | QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES                                   | 20.319.682,33  | 3,199%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 09.290.813/0001-38                                                  | BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA                               | 20.090.570,69  | 3,162%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 11.977.794/0001-64                                                  | BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA                            | 7.254.222,11   | 1,142%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 08.817.414/0001-10                                                  | ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI                     | 44.054.164,09  | 6,935%  | 20,00%                        | 30,00%                 |                                        |                                        |                                |
| 09.087.523/0001-91                                                  | WESTERN ASSET VALUATION FIA                                  | 40.890.945,95  | 6,437%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 15.154.441/0001-15                                                  | CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES               | 7.945.816,68   | 1,251%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
|                                                                     |                                                              | 3.713.742,66   | 0,585%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| <b>FI em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturados)</b> |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 16.437.148/0001-28                                                  | FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II              | 23.274.048,20  | 3,66%   |                               |                        | 0,00%                                  | 3,80%                                  | Artigo 8, Inciso IV, Alínea A  |
| 27.782.774/0001-78                                                  | KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRA | 5.034.278,93   | 0,792%  | 5,00%                         | 5,00%                  |                                        | 5,00%                                  |                                |
|                                                                     |                                                              | 18.239.769,27  | 2,871%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| <b>Fundos de Investimentos no Exterior</b>                          |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 33.913.562/0001-85                                                  | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR    | 25.870.678,85  | 4,07%   |                               |                        | 0,00%                                  | 3,40%                                  | Artigo 9 A, Inciso II          |
| 17.804.792/0001-50                                                  | SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR        | 10.351.949,77  | 1,630%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 31.964.961/0001-40                                                  | BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI        | 10.345.234,33  | 1,628%  | 10,00%                        | 10,00%                 |                                        |                                        |                                |
|                                                                     |                                                              | 5.173.494,75   | 0,814%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| <b>Fundos de Investimentos no Exterior</b>                          |                                                              |                |         |                               |                        |                                        |                                        |                                |
| 19.436.818/0001-80                                                  | SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB                   | 10.844.635,91  | 1,707%  |                               |                        | 0,00%                                  | 2,60%                                  | Artigo 9 A, Inciso III         |
| 17.502.937/0001-68                                                  | FI CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                           | 5.375.069,22   | 0,846%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |
|                                                                     |                                                              | 5.469.566,69   | 0,861%  |                               |                        |                                        |                                        |                                |

Relatório de Investimentos





**BERTIOGA**  
SETEMBRO 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 30.09.2021.

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

REND A FIXA 67,85%

#### 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 150535   | 8,25                | -1,24           | -6,47           | 109.910.193,50 | 17,30      |
| TESOURO NACIONAL                | NTN-B 150824   | 3,67                | 0,98            | 1,08            | 10.313.505,92  | 1,62       |
| TESOURO NACIONAL                | NTN-B 150850   | 9,83                | -1,68           | -8,14           | 11.709.095,16  | 1,84       |
| TESOURO NACIONAL                | NTN-B 150545   | 8,88                | -1,25           | -6,24           | 9.084.123,70   | 1,43       |
| TESOURO NACIONAL                | NTN-B 150523   | 2,55                | 1,15            | 3,01            | 22.708.403,24  | 3,57       |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a |                | 7,11                | -0,81           | -4,92           | 163.725.321,52 | 25,77      |

#### 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 IPCA                         | 2,55                | 1,13            | 2,87            | 16.953.659,09 | 2,67       | 352.300.304,40 | 4,81    |
| BB                              | BB     | BB PREV RF VII                          | 1,58                | 1,30            | 4,66            | 5.795.005,20  | 0,91       | 243.602.920,53 | 2,38    |
| CEF                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF           | 6,57                | -0,49           | -4,90           | 16.160.241,60 | 2,54       | 64.664.276,21  | 24,99   |
| CEF                             | CEF    | CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..         | 3,66                | 0,96            | 0,89            | 19.720.961,00 | 3,10       | 214.143.376,75 | 9,21    |
| BB                              | BB     | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 2,07                | 1,20            | 3,51            | 6.098.910,32  | 0,96       | 577.676.368,77 | 1,06    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b |        |                                         | 3,31                | 0,69            | 0,28            | 64.728.777,21 | 10,19      |                |         |

#### 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 |
|-----------|-----------|------------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------|------------|------------------|---------|
| ITAU      | ITAU      | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI  | 0,68                | 0,84            | 2,32            | 104.013.567,18 | 16,37      | 3.094.123.781,71 | 3,36    |
| BRAM      | BRADERSCO | BRADERSCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA          | 2,86                | -0,15           | -1,65           | 40.158.299,25  | 6,32       | 1.272.446.776,14 | 3,16    |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,28                | 0,45            | 2,45            | 54.170.907,45  | 8,53       | 5.017.787.392,83 | 1,08    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                                        | Admin. | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo    | % Fundo |
|---------------------------------------------------------------|--------|----------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>                       |        |                                        | <b>0,88</b>            | <b>0,53</b>        | <b>1,45</b>        | <b>198.342.773,88</b> | <b>31,22</b> |                |         |
| Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado") |        |                                        |                        |                    |                    |                       |              |                |         |
| Gestor                                                        | Admin. | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo    | % Fundo |
| BB                                                            | BB     | BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | 2,95                   | 0,92               | 1,72               | 4.224.662,25          | 0,67         | 634.085.763,40 | 0,67    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>                      |        |                                        | <b>2,95</b>            | <b>0,92</b>        | <b>1,72</b>        | <b>4.224.662,25</b>   | <b>0,67</b>  |                |         |
| <b>Renda Fixa</b>                                             |        |                                        | <b>3,68</b>            | <b>0,04</b>        | <b>-1,28</b>       | <b>431.021.534,86</b> | <b>67,85</b> |                |         |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,37%

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

| Gestor                                  | Admin.      | Ativo                                            | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------------|-------------|--------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| AZ QUEST                                | BEM         | AZ QUEST ACOES FIC FIA                           | 18,99                  | -4,58              | -7,51              | 20.319.682,33         | 3,20         | 510.385.612,47   | 3,98    |
| BTG PACTUAL                             | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES | 18,75                  | -3,84              | -8,15              | 7.254.222,11          | 1,14         | 95.218.197,61    | 7,62    |
| ITAU                                    | ITAU        | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI          | 19,52                  | -6,60              | -8,41              | 40.890.945,95         | 6,44         | 853.399.264,69   | 4,79    |
| AZ QUEST                                | BEM         | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA               | 19,65                  | -4,19              | -1,53              | 20.090.570,69         | 3,16         | 1.594.005.198,12 | 1,26    |
| WESTERN                                 | BNP PARIBAS | WA ASSET VALUATION FIA                           | 20,15                  | -8,13              | -14,52             | 7.945.816,68          | 1,25         | 147.850.050,17   | 5,37    |
| BTG PACTUAL                             | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA       | 20,91                  | -8,84              | -15,32             | 44.054.164,09         | 6,93         | 2.403.304.462,99 | 1,83    |
| VINCI                                   | CEF         | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS   | 18,49                  | -6,49              | -7,26              | 3.713.742,66          | 0,58         | 1.005.326.835,22 | 0,37    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |             |                                                  | <b>18,99</b>           | <b>-6,64</b>       | <b>-9,97</b>       | <b>144.269.144,51</b> | <b>22,71</b> |                  |         |

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

| Gestor                                             | Admin.      | Ativo                            | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo    | % Fundo |
|----------------------------------------------------|-------------|----------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| KINEA                                              | KINEA       | FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. | 61,74                  | 0,04               | -0,12              | 5.034.278,93          | 0,79         | 35.743.380,50  | 14,08   |
| KINEA                                              | LIONS TRUST | KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME | 51,86                  | -1,09              | 25,36              | 18.239.769,27         | 2,87         | 290.924.330,73 | 6,27    |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>            |             |                                  | <b>46,09</b>           | <b>-0,85</b>       | <b>18,86</b>       | <b>23.274.048,20</b>  | <b>3,66</b>  |                |         |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |             |                                  | <b>17,53</b>           | <b>-5,88</b>       | <b>-6,79</b>       | <b>167.543.192,71</b> | <b>26,37</b> |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,78%

#### Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor                           | Admin.      | Ativo                                                             | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|----------------------------------|-------------|-------------------------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| BB                               | BB          | BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI             | 17,16                  | 1,39               | 10,02              | 5.173.494,75         | 0,81        | 955.234.554,35   | 0,54    |
| XP                               | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 20,66                  | 0,61               | 3,52               | 10.351.949,77        | 1,63        | 1.564.765.916,12 | 0,66    |
| SANTANDER                        | SANTANDER   | SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR        | 16,65                  | 1,33               | 3,45               | 10.345.234,33        | 1,63        | 2.019.466.695,61 | 0,51    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, II</b> |             |                                                                   | <b>13,61</b>           | <b>1,05</b>        | <b>3,47</b>        | <b>25.870.678,85</b> | <b>4,07</b> |                  |         |

#### Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

| Gestor                            | Admin. | Ativo                                      | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| CEF                               | CEF    | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I        | 18,24                  | -0,25              | 9,39               | 5.469.566,69         | 0,86        | 3.337.438.389,61 | 0,16    |
| SAFRA                             | SAFRA  | SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 18,16                  | -0,81              | 7,50               | 5.375.069,22         | 0,85        | 3.470.822.141,78 | 0,15    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, III</b> |        |                                            | <b>13,03</b>           | <b>-0,53</b>       | <b>7,20</b>        | <b>10.844.635,91</b> | <b>1,71</b> |                  |         |

|                                  |  |  |              |             |             |                      |             |  |  |
|----------------------------------|--|--|--------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|
| <b>Investimentos no Exterior</b> |  |  | <b>13,07</b> | <b>0,58</b> | <b>4,35</b> | <b>36.715.314,76</b> | <b>5,78</b> |  |  |
|----------------------------------|--|--|--------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|

|              |  |  |             |              |              |                       |               |  |  |
|--------------|--|--|-------------|--------------|--------------|-----------------------|---------------|--|--|
| <b>Total</b> |  |  | <b>6,37</b> | <b>-1,56</b> | <b>-2,48</b> | <b>635.280.042,33</b> | <b>100,00</b> |  |  |
|--------------|--|--|-------------|--------------|--------------|-----------------------|---------------|--|--|



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

| Política de Investimentos                   |                                                   |                |            |        |          |        |      | Pró-Gestão Nível 2 |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|------------|--------|----------|--------|------|--------------------|
| Artigo                                      | Tipo de Ativo                                     | Valor(R\$)     | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM  | Limite Legal       |
| Renda Fixa                                  |                                                   |                |            |        |          |        |      |                    |
| Artigo 7º I, Alínea a                       | Títulos do Tesouro Nacional                       | 163.725.321,52 | 25,77      | 10,00  | 26,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00             |
| Artigo 7º I, Alínea b                       | Fundos 100% Títulos Públicos                      | 64.728.777,21  | 10,19      | 10,00  | 10,50    | 100,00 | 0,00 | 100,00             |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 198.342.773,88 | 31,22      | 0,00   | 26,00    | 50,00  | 0,00 | 50,00              |
| Artigo 7º VII, Alínea b                     | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"               | 4.224.662,25   | 0,67       | 0,00   | 0,70     | 15,00  | 0,00 | 15,00              |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 431.021.534,86 | 67,85      |        |          |        |      | 100,00             |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |        |          |        |      |                    |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 144.269.144,51 | 22,71      | 0,00   | 26,00    | 30,00  | 0,00 | 30,00              |
| Artigo 8º IV, Alínea a                      | Fundos de Participações                           | 23.274.048,20  | 3,66       | 0,00   | 3,80     | 5,00   | 0,00 | 5,00               |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 167.543.192,71 | 26,37      |        |          |        |      | 40,00              |
| Investimentos no Exterior                   |                                                   |                |            |        |          |        |      |                    |
| Artigo 9º A, II                             | Fundos de Investimento no Exterior                | 25.870.678,85  | 4,07       | 0,00   | 3,40     | 10,00  | 0,00 | 10,00              |
| Artigo 9º A, III                            | Ações - BDR Nível I                               | 10.844.635,91  | 1,71       | 0,00   | 2,60     | 10,00  | 0,00 | 10,00              |
|                                             | Total Investimentos no Exterior                   | 36.715.314,76  | 5,78       |        |          |        |      | 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<br>% do CDI            | -0,81<br>-185,09 | -4,92<br>-196,08 | -3,10<br>-253,81 | -1,15<br>-57,05 | 3,75<br>125,46 | -1.338.819,55         | -8.617.984,58         |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | 0,69<br>158,03   | 0,28<br>11,26    | 0,48<br>39,57    | 2,11<br>104,95  | 4,44<br>148,56 | 445.164,17            | -220.785,41           |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 0,53<br>120,61   | 1,45<br>57,90    | 0,83<br>67,83    | 1,64<br>81,62   | 2,47<br>82,69  | 1.039.697,70          | 2.838.734,03          |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 0,92<br>210,81   | 1,72<br>68,40    | 1,05<br>86,12    | 2,51<br>124,42  | 5,47<br>183,02 | 38.670,33             | 71.231,93             |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -6,64<br>-0,08   | -9,97<br>-3,21   | -15,29<br>-2,82  | -8,12<br>-3,27  | 5,29<br>-12,02 | -10.267.708,91        | -15.971.229,09        |
| Artigo 8º IV, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -0,85<br>5,72    | 18,86<br>25,62   | -2,43<br>10,04   | -3,27<br>1,58   | 13,52<br>-3,79 | -198.383,22           | 3.718.040,67          |
| Artigo 9º A, II<br>% do CDI                  | 1,05<br>240,05   | 3,47<br>195,86   | 6,36<br>519,93   |                 |                | 269.312,52            | 1.105.798,52          |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | -0,53<br>-120,31 | 7,20<br>465,83   | 7,72<br>631,18   |                 |                | -57.478,40            | 844.635,91            |
| <b>BERTIOGA (Total)</b>                      |                  |                  |                  |                 |                | <b>-10.069.545,36</b> | <b>-16.231.558,02</b> |

### 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 150523 | 22.450.027,55  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 22.708.403,24  | 258.375,69                  | 671.861,88                  |
| NTN-B 150535 | 111.292.300,37 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 109.910.193,50 | -1.382.106,87               | -7.716.810,00               |
| NTN-B 150545 | 9.199.155,59   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.084.123,70   | -115.031,89                 | -611.433,10                 |
| NTN-B 150824 | 10.213.162,52  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 10.313.505,92  | 100.343,40                  | 107.979,65                  |
| NTN-B 150850 | 11.909.495,04  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 11.709.095,16  | -200.399,88                 | -1.069.583,01               |
|              |                |            |          |             | 163.725.321,52 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 7º I, Alínea b



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|-----------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB PREV RF IPCA                         | 16.763.626,44  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 16.953.659,09 | 190.032,65                     | 477.464,99                     |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 6.026.751,63   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 6.098.910,32  | 72.158,69                      | 210.700,13                     |
| BB PREV RF VII                          | 5.720.816,77   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.795.005,20  | 74.188,43                      | 263.991,12                     |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..         | 19.533.397,00  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 19.720.961,00 | 187.564,00                     | 170.213,84                     |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF           | 16.239.021,20  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 16.160.241,60 | -78.779,60                     | -863.742,83                    |
|                                         |                |            |          |             | 64.728.777,21 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo                                          | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates    | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|------------------------------------------------|----------------|--------------|-------------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA           | 40.220.235,68  | 0,00         | 0,00        | 0,00        | 40.158.299,25  | -61.936,43                     | -672.746,46                    |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI  | 103.150.278,73 | 0,00         | 0,00        | 0,00        | 104.013.567,18 | 863.288,45                     | 2.362.112,24                   |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 51.732.561,77  | 3.100.000,00 | -900.000,00 | 0,00        | 54.170.907,45  | 238.345,68                     | 1.149.368,25                   |
|                                                |                |              |             |             | 198.342.773,88 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 7º VII, Alínea b

| Ativo                                  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | 4.185.991,92   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.224.662,25 | 38.670,33                      | 71.231,93                      |
|                                        |                |            |          |             | 4.224.662,25 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 8º II, Alínea a

| Ativo                                            | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| AZ QUEST ACOES FIC FIA                           | 21.295.133,60  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 20.319.682,33  | -975.451,27                    | -1.650.633,14                  |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA               | 20.969.019,80  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 20.090.570,69  | -878.449,11                    | -312.019,55                    |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA       | 48.326.770,93  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 44.054.164,09  | -4.272.606,84                  | -7.970.078,67                  |
| BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES | 7.543.976,44   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 7.254.222,11   | -289.754,33                    | -643.828,90                    |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS   | 3.971.306,68   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.713.742,66   | -257.564,02                    | -290.889,37                    |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI          | 43.782.124,38  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 40.890.945,95  | -2.891.178,43                  | -3.754.014,43                  |
| WA ASSET VALUATION FIA                           | 8.648.521,59   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 7.945.816,68   | -702.704,91                    | -1.349.765,03                  |
|                                                  |                |            |          |             | 144.269.144,51 | 0,00                           | 0,00                           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Artigo 8º IV, Alínea a

| Ativo                            | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. | 5.032.361,50   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.034.278,93  | 1.917,43                       | -5.997,49                      |
| KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME | 18.440.069,92  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 18.239.769,27 | -200.300,65                    | 3.724.038,16                   |
|                                  |                |            |          |             | 23.274.048,20 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 9º A, II

| Ativo                                                             | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI             | 5.102.612,50   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.173.494,75  | 70.882,25                      | 408.614,42                     |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 10.289.337,16  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 10.351.949,77 | 62.612,61                      | 351.949,77                     |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR        | 10.209.416,67  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 10.345.234,33 | 135.817,66                     | 345.234,33                     |
|                                                                   |                |            |          |             | 25.870.678,85 | 0,00                           | 0,00                           |

### Artigo 9º A, III

| Ativo                                      | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I        | 5.483.280,14   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.469.566,69  | -13.713,45                     | 469.566,69                     |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 5.418.834,17   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.375.069,22  | -43.764,95                     | 375.069,22                     |
|                                            |                |            |          |             | 10.844.635,91 | 0,00                           | 0,00                           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

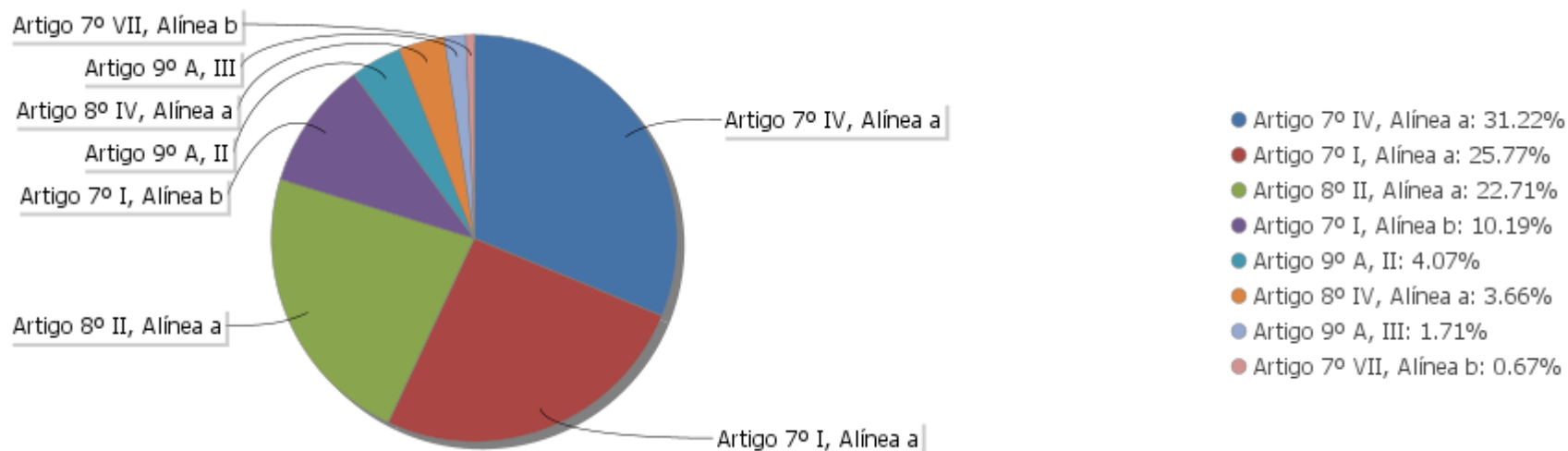
## Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 352.753.846,93 | 55,53 | 352.753.846,93        | 55,53     |
| de 31 a 365 dias  | 53.562.911,95  | 8,43  | 406.316.758,88        | 63,96     |
| acima de 365 dias | 228.963.283,45 | 36,04 | 635.280.042,33        | 100,00    |

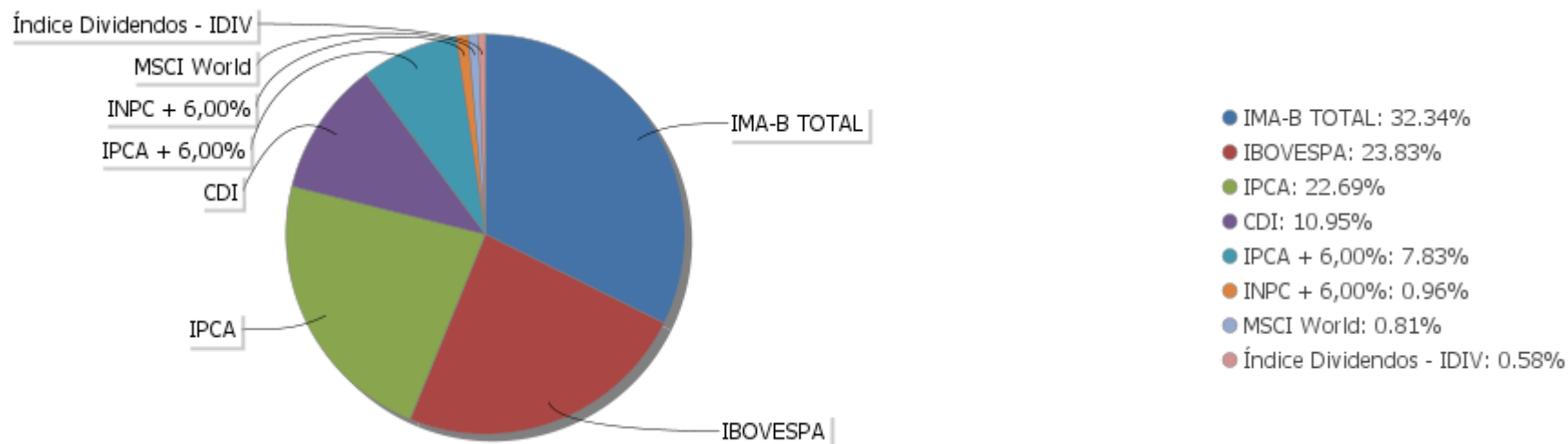


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

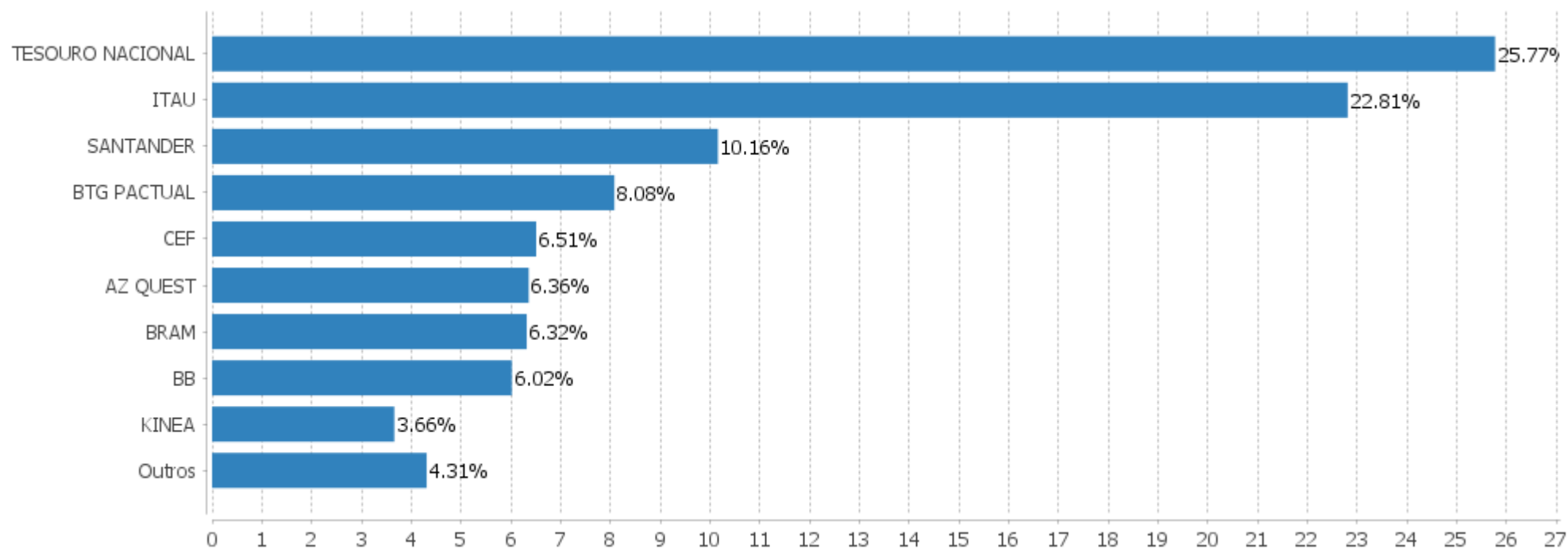


### Alocação Por Estratégia



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           | -0,82 | -0,86 | 0,46   | 1,08  | 1,44  | 0,49  | -1,18 | -1,50 | -1,56 |       |       |      | -2,48     |
| IPCA + 5,46%   | 0,67  | 1,24  | 1,42   | 0,73  | 1,28  | 0,98  | 1,43  | 1,34  | 1,61  |       |       |      | 11,22     |
| p.p. indexador | -1,49 | -2,11 | -0,96  | 0,35  | 0,17  | -0,48 | -2,61 | -2,84 | -3,17 |       |       |      | -13,70    |
| 2020           | 0,98  | -1,02 | -11,57 | 3,30  | 2,82  | 3,36  | 4,26  | -1,37 | -1,94 | -0,52 | 3,57  | 4,22 | 5,06      |
| IPCA + 5,89%   | 0,71  | 0,66  | 0,57   | 0,14  | 0,07  | 0,74  | 0,89  | 0,72  | 1,12  | 1,34  | 1,35  | 1,86 | 10,65     |
| p.p. indexador | 0,27  | -1,68 | -12,15 | 3,15  | 2,75  | 2,62  | 3,37  | -2,09 | -3,06 | -1,87 | 2,22  | 2,36 | -5,59     |
| 2019           | 4,65  | -0,50 | 0,16   | 1,38  | 2,73  | 3,38  | 1,58  | 0,31  | 1,87  | 2,49  | -0,78 | 2,81 | 21,87     |
| 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 | 3,82  | -1,39 | -1,04  | 0,32  | 2,09  | 2,93  | 0,86  | -0,31 | 1,42  | 1,86  | -1,76 | 1,17 | 11,28     |
| 2018           | 4,47  | 0,74  | 0,98   | -0,04 | -4,30 | -1,08 | 2,86  | -1,15 | 0,17  | 6,78  | 0,37  | 1,36 | 11,27     |
| IPCA + 6,00%   | 0,80  | 0,74  | 0,58   | 0,71  | 0,89  | 1,75  | 0,84  | 0,44  | 0,92  | 0,96  | 0,25  | 0,61 | 9,92      |
| p.p. indexador | 3,67  | -0,00 | 0,40   | -0,75 | -5,19 | -2,83 | 2,02  | -1,60 | -0,75 | 5,82  | 0,11  | 0,75 | 1,35      |
| 2017           | 2,46  | 3,79  | 0,60   | -0,18 | -1,48 | 0,41  | 6,44  | 2,39  | 2,45  | -0,71 | -1,44 | 1,85 | 17,56     |
| IPCA + 6,00%   | 0,89  | 0,75  | 0,78   | 0,56  | 0,82  | 0,26  | 0,73  | 0,72  | 0,62  | 0,91  | 0,74  | 0,91 | 9,05      |
| p.p. indexador | 1,57  | 3,04  | -0,19  | -0,74 | -2,30 | 0,16  | 5,71  | 1,67  | 1,83  | -1,62 | -2,18 | 0,95 | 8,52      |

### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

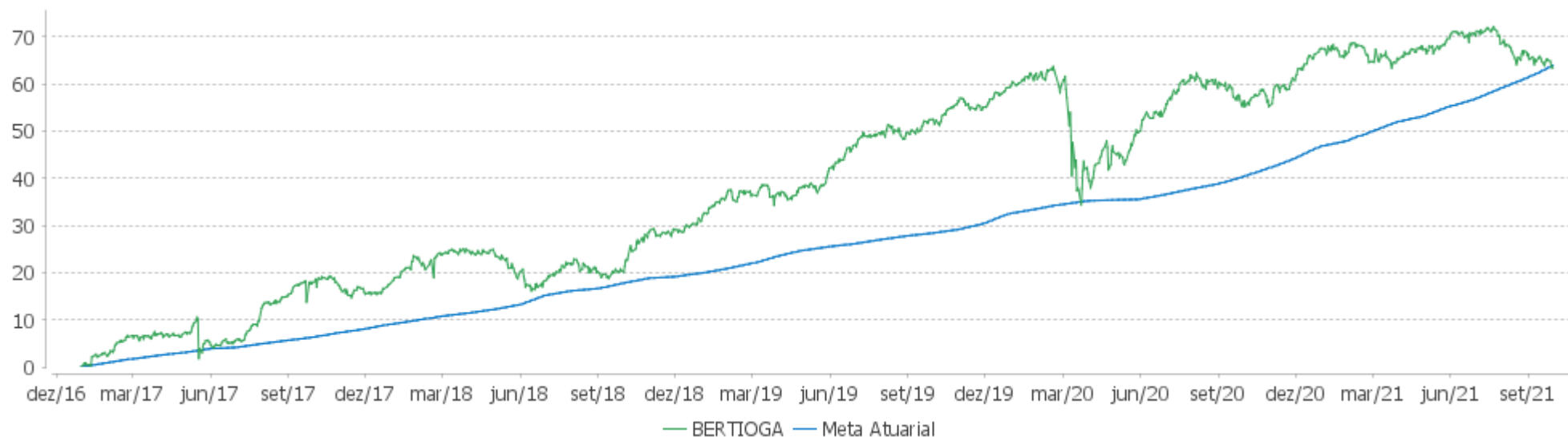
|                              | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 30         | 52,63     | 03 meses         | -4,18    | 4,44          | -8,62      | 6,27               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 27         | 47,37     | 06 meses         | -1,26    | 7,59          | -8,85      | 5,86               |
|                              |            |           | 12 meses         | 4,71     | 16,36         | -11,65     | 6,37               |
|                              |            |           | 24 meses         | 7,12     | 27,11         | -19,99     | 11,44              |
|                              |            |           | 36 meses         | 35,64    | 38,60         | -2,96      | 10,10              |
|                              |            |           | 48 meses         | 38,47    | 53,46         | -14,99     | 9,70               |
|                              |            |           | Desde 30/12/2016 | 63,33    | 63,14         | 0,19       | 10,26              |

|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 6,78          | 2018-10 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -11,57        | 2020-03 |

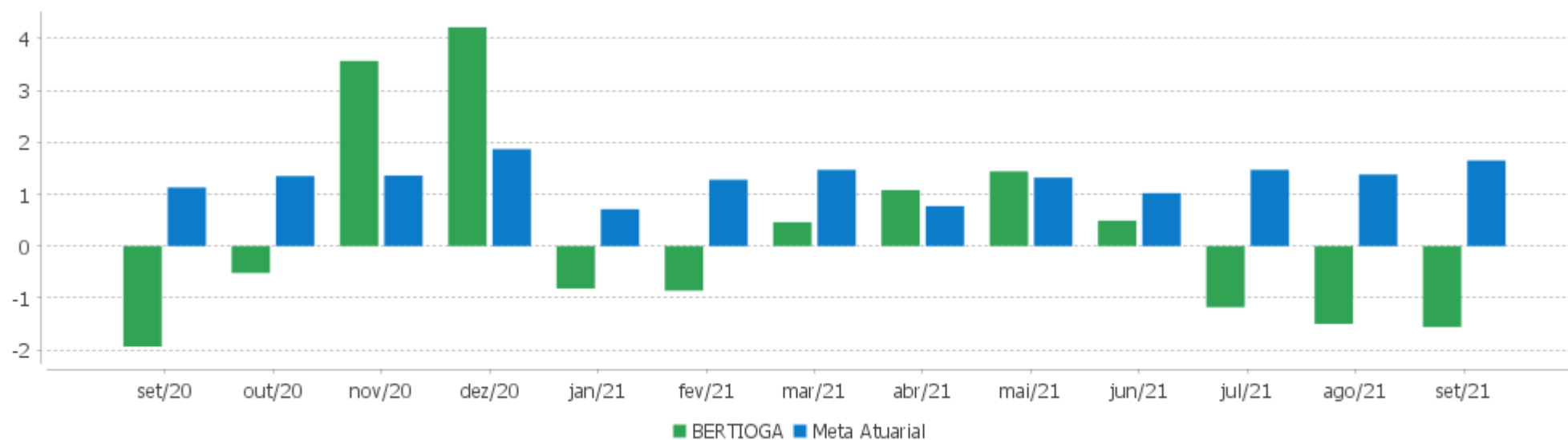


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                   | No Mês         | No Ano         | 3 meses         | 6 meses         | 12 meses          | 24 meses          | 36 meses          |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.   | 0,84<br>-0,32  | 2,32<br>-4,58  | 1,30<br>-1,72   | 1,98<br>-2,77   | 2,72<br>-7,53     | 6,51<br>-7,19     | 21,07<br>4,08     |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI<br>% do CDI        | 0,45<br>101,65 | 2,45<br>97,60  | 1,25<br>102,37  | 1,99<br>98,76   | 2,87<br>95,94     | 6,08<br>91,33     |                   |
| BRASESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA<br>Var. IPCA p.p.            | -0,15<br>-1,31 | -1,65<br>-8,55 | -0,86<br>-3,88  | 0,43<br>-4,32   | 1,30<br>-8,95     | 4,80<br>-8,90     | 22,19<br>5,20     |
| NTN-B 150824<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | 0,98<br>1,12   | 1,08<br>3,38   | 0,82<br>2,41    | 2,59<br>2,07    | 5,12<br>0,41      | 13,44<br>6,52     | 40,50<br>0,04     |
| NTN-B 150545<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | -1,25<br>-1,12 | -6,24<br>-3,94 | -4,69<br>-3,10  | -1,86<br>-2,38  | 4,10<br>-0,61     | 0,48<br>-6,44     | 47,29<br>6,83     |
| NTN-B 150850<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | -1,68<br>-1,55 | -8,14<br>-5,84 | -5,44<br>-3,85  | -2,10<br>-2,62  | 3,06<br>-1,65     | -2,37<br>-9,29    | 51,45<br>10,99    |
| NTN-B 150535<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | -1,24<br>-1,11 | -6,47<br>-4,17 | -3,97<br>-2,38  | -2,17<br>-2,69  | 3,21<br>-1,50     | 4,22<br>-2,70     | 43,42<br>2,96     |
| NTN-B 150523<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                             | 1,15<br>1,28   | 3,01<br>5,31   | 1,47<br>3,06    | 3,16<br>2,64    | 6,08<br>1,37      | 15,21<br>8,30     | 39,37<br>-1,09    |
| BB PREV RF VII<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                           | 1,30<br>1,43   | 4,66<br>6,96   | 2,42<br>4,01    | 3,97<br>3,45    | 7,69<br>2,98      | 13,21<br>6,29     | 26,80<br>-13,66   |
| BB PREV RF IPCA<br>Var. IPCA + 6,00% p.p.                         | 1,13<br>-0,52  | 2,87<br>-8,78  | 1,42<br>-3,16   | 3,06<br>-4,81   | 5,87<br>-10,96    | 14,76<br>-12,96   | 38,55<br>-0,73    |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.            | -0,49<br>-0,35 | -4,90<br>-2,60 | -1,95<br>-0,36  | 0,04<br>-0,48   | 2,94<br>-1,77     | 5,78<br>-1,14     | 43,03<br>2,57     |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI<br>Var. INPC + 6,00% p.p. | 1,20<br>-0,50  | 3,51<br>-8,46  | 1,92<br>-2,77   | 3,52<br>-4,76   | 6,84<br>-10,56    | 13,46<br>-15,83   | 31,18<br>-9,83    |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.          | 0,96<br>1,09   | 0,89<br>3,19   | 0,75<br>2,34    | 2,45<br>1,93    | 4,85<br>0,14      | 12,87<br>5,95     | 39,46<br>-1,00    |
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI<br>Var. IPCA + 6,00% p.p.  | 0,92<br>-0,73  | 1,72<br>-9,93  | 1,05<br>-3,53   | 2,51<br>-5,36   | 5,47<br>-11,36    | 12,48<br>-15,24   | 28,59<br>-10,69   |
| KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME<br>Var. IPCA + 6,00% p.p.        | -1,09<br>-2,74 | 25,36<br>13,71 | -3,05<br>-7,63  | -4,50<br>-12,37 | 24,54<br>7,71     | 66,64<br>38,92    | 211,82<br>172,54  |
| FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..<br>% do CDI                      | 0,04<br>8,69   | -0,12<br>-4,75 | -0,13<br>-10,78 | -0,53<br>-26,47 | -12,29<br>-410,92 | -18,30<br>-275,03 | -43,49<br>-325,81 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA                        | -8,84          | -15,32         | -18,94          | -14,07          | -4,83             | 0,46              | 52,93             |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                                             | No Mês         | No Ano          | 3 meses         | 6 meses        | 12 meses        | 24 meses          | 36 meses        |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------|-----------------|----------------|-----------------|-------------------|-----------------|
| Var. IBOVESPA p.p.                                                                          | -2,27          | -8,57           | -6,47           | -9,22          | -22,14          | -5,50             | 13,05           |
| WA ASSET VALUATION FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                                | -8,13<br>-1,56 | -14,52<br>-7,77 | -16,80<br>-4,33 | -9,75<br>-4,90 | 1,54<br>-15,77  | -3,41<br>-9,36    | 32,18<br>-7,70  |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                                | -4,58<br>1,99  | -7,51<br>-0,76  | -14,14<br>-1,66 | -4,51<br>0,34  | 8,01<br>-9,30   | -2,82<br>-8,77    | 30,28<br>-9,59  |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.        | -6,49<br>-2,00 | -7,26<br>-2,59  | -10,65<br>-4,05 | -4,65<br>-3,14 | 15,95<br>-3,63  | 7,86<br>0,01      | 66,44<br>1,61   |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                    | -4,19<br>2,38  | -1,53<br>5,22   | -13,08<br>-0,60 | -1,14<br>3,71  | 15,16<br>-2,15  | 14,06<br>8,11     | 80,26<br>40,38  |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | -6,60<br>-0,04 | -8,41<br>-1,65  | -13,64<br>-1,16 | -6,12<br>-1,27 | 11,40<br>-5,91  | 5,54<br>-0,41     | 45,87<br>5,99   |
| BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES<br>Var. IBOVESPA p.p.                      | -3,84<br>2,73  | -8,15<br>-1,40  | -10,77<br>1,71  | -8,12<br>-3,27 | 7,56<br>-9,75   | -0,44<br>-6,39    | 41,26<br>1,38   |
| BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI<br>Var. MSCI World p.p.               | 1,39<br>0,17   | 19,44<br>2,45   | 9,77<br>1,41    | 4,09<br>2,00   | 25,24<br>2,77   |                   |                 |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR<br>% do CDI                      | 1,33<br>303,57 | 15,97<br>636,83 | 7,99<br>653,68  | 2,32<br>115,01 | 20,85<br>697,26 | 95,63<br>1.437,23 |                 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR<br>Var. IPCA + 6,00% p.p. | 0,61<br>-1,04  | 5,53<br>-6,12   | 3,25<br>-1,33   | -0,98<br>-8,85 | 8,39<br>-8,45   |                   |                 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I<br>Var. IBOVESPA p.p.                                   | -0,25<br>6,32  | 16,72<br>23,48  | 7,72<br>20,20   | 3,03<br>7,87   | 18,25<br>0,94   | 90,64<br>84,69    | 101,42<br>61,54 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB<br>Var. IBOVESPA p.p.                            | -0,81<br>5,76  | 19,04<br>25,79  | 7,72<br>20,20   | 6,60<br>11,44  | 20,62<br>3,31   | 79,55<br>73,59    | 105,43<br>65,56 |
| BERTIOGA<br>Var. IPCA + 6,00% p.p.                                                          | -1,56<br>-3,21 | -2,48<br>-14,12 | -4,18<br>-8,76  | -1,26<br>-9,13 | 4,71<br>-12,12  | 7,12<br>-20,61    | 35,64<br>-3,63  |
| CDI                                                                                         | 0,44           | 2,51            | 1,22            | 2,01           | 2,99            | 6,65              | 13,35           |
| IBOVESPA                                                                                    | -6,57          | -6,75           | -12,48          | -4,85          | 17,31           | 5,95              | 39,87           |
| INPC + 6,00%                                                                                | 1,69           | 11,97           | 4,69            | 8,28           | 17,40           | 29,29             | 41,02           |
| IPCA + 6,00%                                                                                | 1,65           | 11,65           | 4,58            | 7,87           | 16,83           | 27,73             | 39,28           |

## 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              | 0,40   | 1,78   | 0,96    | 1,65    | 2,49     | 7,15     | 15,12    | 22,90    | 38,45    |
| IRF-M 1+             | -0,73  | -5,87  | -2,65   | -1,15   | -3,14    | 4,23     | 25,92    | 32,64    | 58,13    |
| IRF-M TOTAL          | -0,33  | -2,95  | -1,39   | -0,15   | -1,02    | 5,48     | 23,23    | 30,30    | 53,03    |
| IMA-B 5              | 1,00   | 2,48   | 1,18    | 2,64    | 5,95     | 13,62    | 31,12    | 39,68    | 58,47    |
| IMA-B 5+             | -1,26  | -6,63  | -4,19   | -1,61   | 3,20     | 1,48     | 46,98    | 45,78    | 70,99    |
| IMA-B TOTAL          | -0,13  | -2,30  | -1,59   | 0,52    | 4,71     | 6,92     | 40,46    | 44,04    | 66,75    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,02   | -0,76  | -0,42   | 0,89    | 2,05     | 6,02     | 23,59    | 29,99    | 49,60    |
| IMA-GERAL TOTAL      | -0,01  | -0,38  | -0,52   | 0,96    | 2,48     | 6,93     | 24,87    | 31,60    | 51,09    |
| IDKA 2               | 1,10   | 3,07   | 1,18    | 3,12    | 6,21     | 14,71    | 29,45    | 40,48    | 59,67    |
| IDKA 20              | -3,03  | -11,97 | -8,65   | -5,13   | 2,03     | -7,04    | 59,98    | 49,40    | 80,44    |
| CDI                  | 0,44   | 2,51   | 1,22    | 2,01    | 2,99     | 6,65     | 13,35    | 20,90    | 34,86    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -6,57  | -6,75  | -12,48  | -4,85   | 17,31    | 5,95     | 39,87    | 49,38    | 90,14    |
| IBRX 100                 | -6,99  | -5,99  | -13,61  | -5,31   | 17,82    | 7,71     | 45,23    | 53,72    | 95,90    |
| IBRX 50                  | -7,47  | -6,33  | -14,15  | -5,58   | 18,46    | 6,59     | 37,53    | 47,56    | 87,32    |
| SMALL CAP                | -6,43  | -5,54  | -15,22  | -4,70   | 15,75    | 13,69    | 78,82    | 65,15    | 133,65   |
| IFIX                     | -1,24  | -5,38  | -1,42   | -4,61   | -2,83    | 1,17     | 27,21    | 22,27    | 49,54    |
| Índice Consumo - ICON    | -5,95  | -11,50 | -14,34  | -7,48   | -1,67    | -2,69    | 50,48    | 25,77    | 51,19    |
| Índice Dividendos - IDIV | -4,48  | -4,67  | -6,59   | -1,51   | 19,58    | 7,85     | 64,83    | 56,04    | 121,60   |



## 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      | 1,16   | 6,90   | 3,02    | 4,75    | 10,25    | 13,70    | 16,99    | 22,29    | 25,39    |
| INPC      | 1,20   | 7,21   | 3,13    | 5,14    | 10,78    | 15,09    | 18,46    | 23,16    | 25,17    |
| IGPM      | -0,64  | 16,00  | 0,80    | 7,15    | 24,86    | 47,25    | 52,21    | 67,49    | 65,07    |
| SELIC     | 0,44   | 2,50   | 1,21    | 2,01    | 2,99     | 6,64     | 13,32    | 20,87    | 34,83    |

## 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    | 0,73   | 20,04  | 8,99    | 3,52    | 23,52    | 89,01    | 100,82   | 193,57   | 232,88   |
| MSCI ACWI  | 1,23   | 14,91  | 7,16    | 0,61    | 21,06    | 78,00    | 83,86    | 150,21   | 184,12   |
| MSCI World | 1,22   | 16,99  | 8,36    | 2,09    | 22,47    | 80,14    | 87,02    | 158,04   | 191,94   |

## Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,49   | 10,07  | 4,07    | 6,84    | 14,64    | 22,96    | 31,56    | 42,95    | 52,39    |
| IPCA + 5,00% | 1,57   | 10,86  | 4,32    | 7,36    | 15,74    | 25,33    | 35,38    | 48,50    | 59,82    |
| IPCA + 5,50% | 1,61   | 11,26  | 4,45    | 7,61    | 16,29    | 26,53    | 37,32    | 51,33    | 63,64    |
| IPCA + 5,89% | 1,64   | 11,56  | 4,55    | 7,81    | 16,71    | 27,46    | 38,84    | 53,57    | 66,67    |
| IPCA + 6,00% | 1,65   | 11,65  | 4,58    | 7,87    | 16,83    | 27,73    | 39,28    | 54,21    | 67,53    |
| INPC + 4,00% | 1,53   | 10,39  | 4,18    | 7,24    | 15,20    | 24,46    | 33,20    | 43,97    | 52,12    |
| INPC + 6,00% | 1,69   | 11,97  | 4,69    | 8,28    | 17,40    | 29,29    | 41,02    | 55,31    | 67,23    |

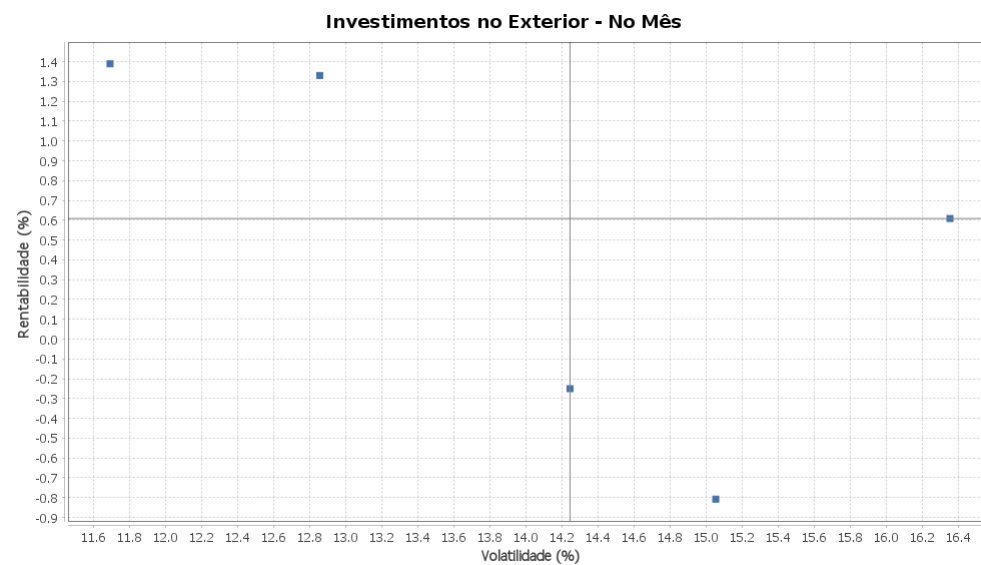
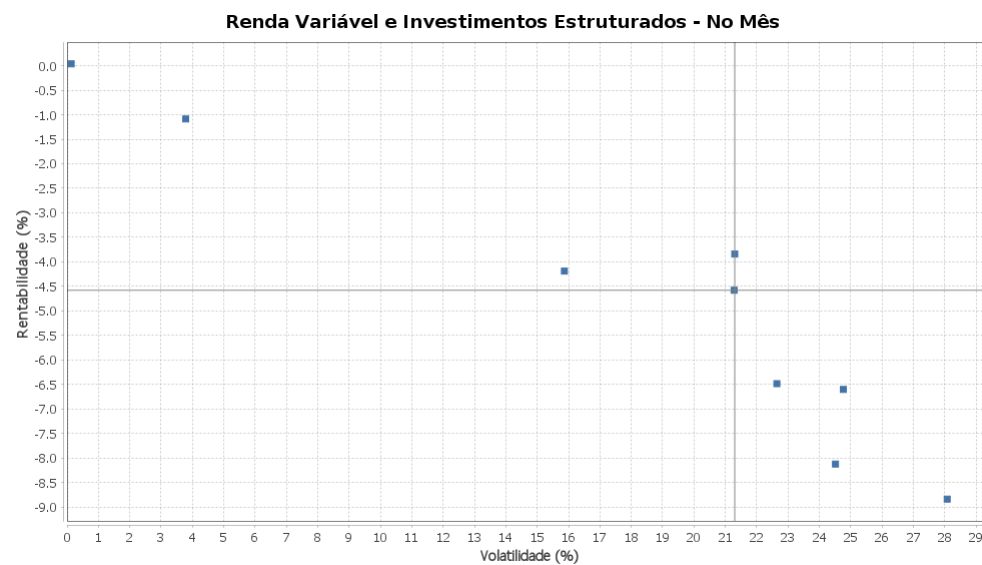
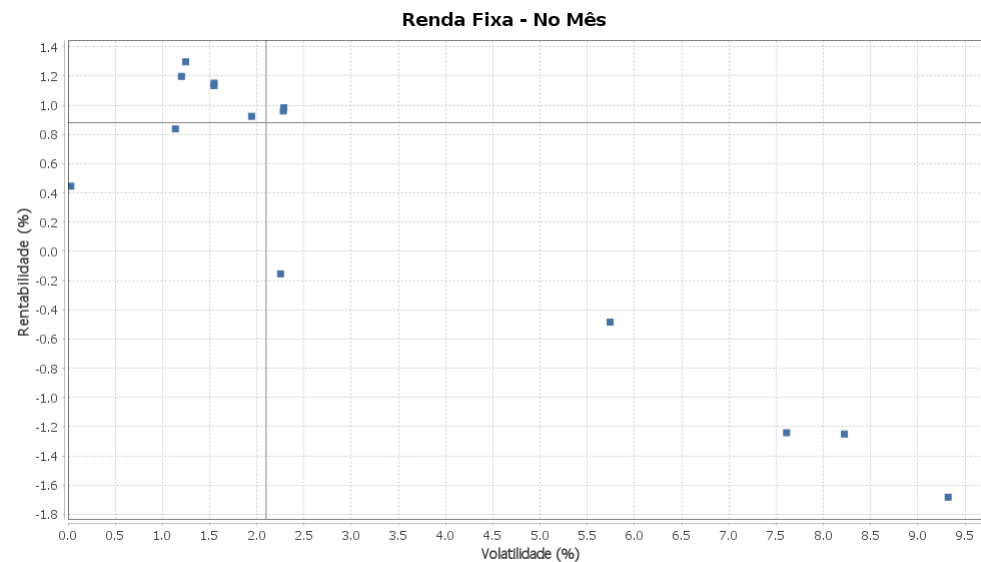
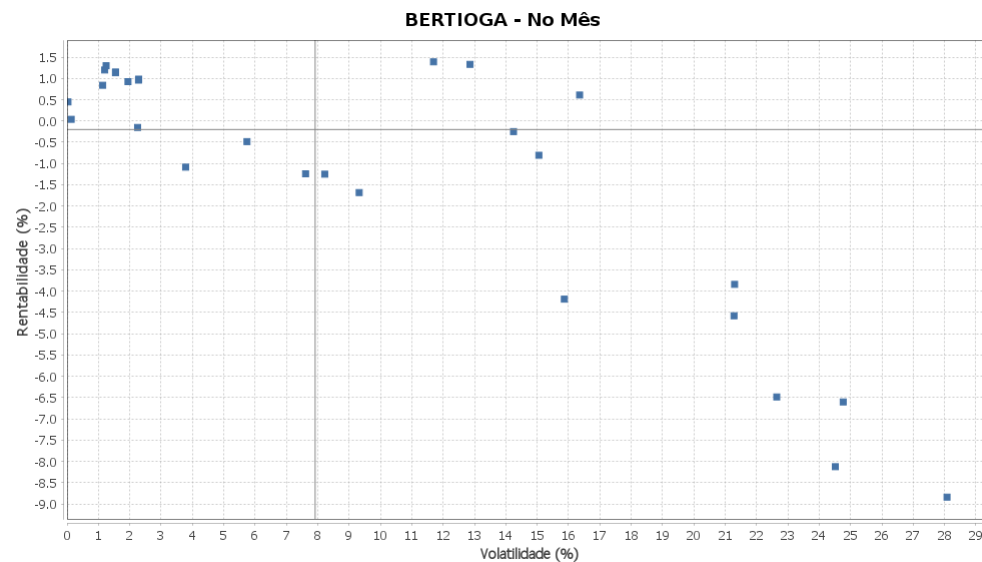
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR   | Data       | Ativo                                          | Aplicação    | Resgate    | Quantidade      | Valor Cota    |
|-------|------------|------------------------------------------------|--------------|------------|-----------------|---------------|
| 61    | 03/09/2021 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 200.000,00   | 0,00       | 6.888,75728600  | 29,0328127000 |
| 62    | 14/09/2021 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 2.800.000,00 | 0,00       | 96.324,57020800 | 29,0683882000 |
| 63    | 30/09/2021 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,00         | 900.000,00 | 30.882,57870200 | 29,1426441000 |
| 64    | 30/09/2021 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 100.000,00   | 0,00       | 3.431,39763400  | 29,1426441000 |
| Total |            |                                                |              |            |                 |               |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 17.422.456,50

Value-At-Risk: 2,74%

| Ativo                                                             | Estratégia              | Volatilidade | VaR  | CVaR  | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|-------------------------------------------------------------------|-------------------------|--------------|------|-------|--------|-------|----------------|------------|
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI                    | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,03         | 0,03 | -0,00 | 0,24   | 0,45  | 54.170.907,45  | 8,53       |
| FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..                                  | Artigo 8º IV, Alínea a  | 0,13         | 0,02 | 0,00  | -3,03  | 0,04  | 5.034.278,93   | 0,79       |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI                     | Artigo 7º IV, Alínea a  | 1,14         | 0,52 | 0,05  | 0,35   | 0,84  | 104.013.567,18 | 16,37      |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI                           | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,20         | 0,67 | 0,00  | 0,63   | 1,20  | 6.098.910,32   | 0,96       |
| BB PREV RF VII                                                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,25         | 0,55 | 0,00  | 0,69   | 1,30  | 5.795.005,20   | 0,91       |
| BB PREV RF IPCA                                                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,55         | 0,95 | 0,01  | 0,45   | 1,13  | 16.953.659,09  | 2,67       |
| NTN-B 150523                                                      | Artigo 7º I, Alínea a   | 1,55         | 0,95 | 0,01  | 0,46   | 1,15  | 22.708.403,24  | 3,57       |
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI                            | Artigo 7º VII, Alínea b | 1,94         | 1,27 | 0,01  | 0,25   | 0,92  | 4.224.662,25   | 0,67       |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA                              | Artigo 7º IV, Alínea a  | 2,25         | 1,26 | 0,06  | -0,26  | -0,15 | 40.158.299,25  | 6,32       |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..                                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,28         | 1,63 | 0,03  | 0,23   | 0,96  | 19.720.961,00  | 3,10       |
| NTN-B 150824                                                      | Artigo 7º I, Alínea a   | 2,29         | 1,64 | 0,02  | 0,24   | 0,98  | 10.313.505,92  | 1,62       |
| KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME                                  | Artigo 8º IV, Alínea a  | 3,78         | 2,66 | -0,01 | -0,40  | -1,09 | 18.239.769,27  | 2,87       |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF                                     | Artigo 7º I, Alínea b   | 5,74         | 3,37 | 0,07  | -0,16  | -0,49 | 16.160.241,60  | 2,54       |
| NTN-B 150535                                                      | Artigo 7º I, Alínea a   | 7,61         | 4,26 | 0,56  | -0,22  | -1,24 | 109.910.193,50 | 17,30      |
| NTN-B 150545                                                      | Artigo 7º I, Alínea a   | 8,22         | 4,32 | 0,05  | -0,21  | -1,25 | 9.084.123,70   | 1,43       |
| NTN-B 150850                                                      | Artigo 7º I, Alínea a   | 9,32         | 4,61 | 0,06  | -0,23  | -1,68 | 11.709.095,16  | 1,84       |
| BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI             | Artigo 9º A, II         | 11,69        | 5,81 | -0,01 | 0,08   | 1,39  | 5.173.494,75   | 0,81       |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR        | Artigo 9º A, II         | 12,86        | 5,86 | -0,02 | 0,07   | 1,33  | 10.345.234,33  | 1,63       |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                               | Artigo 9º A, III        | 14,25        | 6,65 | -0,01 | -0,05  | -0,25 | 5.469.566,69   | 0,86       |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB                        | Artigo 9º A, III        | 15,05        | 6,34 | -0,00 | -0,08  | -0,81 | 5.375.069,22   | 0,85       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                                | Artigo 8º II, Alínea a  | 15,87        | 7,99 | 0,22  | -0,29  | -4,19 | 20.090.570,69  | 3,16       |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | Artigo 9º A, II         | 16,35        | 7,72 | -0,02 | 0,01   | 0,61  | 10.351.949,77  | 1,63       |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA                                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 21,28        | 8,39 | 0,24  | -0,24  | -4,58 | 20.319.682,33  | 3,20       |
| BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES                  | Artigo 8º II, Alínea a  | 21,30        | 8,63 | 0,09  | -0,20  | -3,84 | 7.254.222,11   | 1,14       |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS                    | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,64        | 7,63 | 0,04  | -0,31  | -6,49 | 3.713.742,66   | 0,58       |
| WA ASSET VALUATION FIA                                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 24,51        | 9,99 | 0,12  | -0,35  | -8,13 | 7.945.816,68   | 1,25       |



Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 30/09/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                      | Estratégia             | Volatilidade | VaR   | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--------------------------------------------|------------------------|--------------|-------|------|--------|-------|---------------|------------|
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI    | Artigo 8º II, Alínea a | 24,76        | 8,78  | 0,52 | -0,28  | -6,60 | 40.890.945,95 | 6,44       |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 28,08        | 10,69 | 0,66 | -0,33  | -8,84 | 44.054.164,09 | 6,93       |