

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

86,27%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Ano | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,750000%) | 0,62 | 0,08 | 0,73 | 8,28 | 576.116,25 | 0,25 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,680000%) | 0,49 | 0,08 | 0,73 | 8,22 | 10.583.418,55 | 4,55 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,760000%) | 0,50 | 0,08 | 0,73 | 8,28 | 42.438.904,90 | 18,24 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,790000%) | 0,50 | 0,08 | 0,74 | 8,31 | 10.603.196,42 | 4,56 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,790000%) | 1,12 | 0,08 | 0,74 | 8,31 | 9.724.457,93 | 4,18 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,820000%) | 1,13 | 0,08 | 0,74 | 8,33 | 511.586,58 | 0,22 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,820000%) | 1,13 | 0,08 | 0,74 | 8,33 | 5.135.799,74 | 2,21 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,930000%) | 1,14 | 0,08 | 0,75 | 8,42 | 6.153.295,91 | 2,65 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,53 | 0,08 | 0,73 | 8,30 | 85.726.776,28 | 36,85 |

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 | Ano | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,37 | 0,05 | 0,90 | 9,81 | 1.262.965,62 | 0,54 | 7.028.296.292,55 | 0,02 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,36 | 0,06 | 0,91 | 9,91 | 31.985.957,34 | 13,75 | 7.513.988.203,57 | 0,43 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,19 | 0,22 | 0,11 | 8,79 | 15.522.228,61 | 6,67 | 8.162.684.334,70 | 0,19 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 2,28 | 0,19 | 0,21 | 8,59 | 3.665.061,00 | 1,58 | 6.063.437.379,24 | 0,06 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,35 | 0,19 | 0,36 | 8,79 | 5.502.328,16 | 2,37 | 5.412.384.350,74 | 0,10 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2,21 | 0,22 | 0,11 | 8,75 | 17.333.714,95 | 7,45 | 5.453.684.801,95 | 0,32 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|---|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 3,86 | 0,41 | -0,30 | 11,35 | 5.416.792,53 | 2,33 | 2.195.169.805,31 | 0,25 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,61 | 0,16 | 0,44 | 9,38 | 80.689.048,21 | 34,69 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|--------------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|-------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B | 4,94 | 0,52 | -0,97 | 1,22 | 10.082.333,41 | 4,33 | 923.636.374,46 | 1,09 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,08 | 0,05 | 0,97 | 4,24 | 5.211.571,65 | 2,24 | 15.259.689.366,93 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,02 | 0,05 | 0,90 | 9,12 | 36.586,87 | 0,02 | 3.380.807.738,12 | 0,00 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 2,97 | 0,26 | 0,14 | 11,18 | 17.541.449,61 | 7,54 | 720.074.390,87 | 2,44 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 3,03 | 0,30 | -0,07 | 10,60 | 32.871.941,54 | 14,13 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|------------|---|---------------------|-------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| GRAPHEN | CM CAPITAL | GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS | 4,46 | -0,26 | -0,26 | 0,61 | 1.396.813,06 | 0,60 | 125.549.744,31 | 1,11 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | | | 4,46 | -0,26 | -0,26 | 0,61 | 1.396.813,06 | 0,60 | | |
| Renda Fixa | | | 1,03 | 0,15 | 0,48 | 8,88 | 200.684.579,09 | 86,27 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

1,94%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|----------------------------------|------------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 19,40 | 0,82 | -0,12 | 11,80 | 4.511.474,68 | 1,94 | 640.342.651,56 | 0,70 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 19,40 | 0,82 | -0,12 | 11,80 | 4.511.474,68 | 1,94 | | |
| Renda Variável | | | 19,40 | 0,82 | -0,12 | 11,80 | 4.511.474,68 | 1,94 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,01%

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 | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 21,98 | -0,35 | -3,57 | 16,05 | 9.336.597,45 | 4,01 | 1.999.422.357,55 | 0,47 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 21,98 | -0,35 | -3,57 | 16,05 | 9.336.597,45 | 4,01 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 21,98 | -0,35 | -3,57 | 16,05 | 9.336.597,45 | 4,01 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,79%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|--------|--|---------------------|-------------------|--------------|--------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 17,01 | -0,24 | -4,46 | 17,90 | 12.931.819,63 | 5,56 | 1.537.651.847,22 | 0,84 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 17,01 | -0,24 | -4,46 | 17,90 | 12.931.819,63 | 5,56 | | |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|---------|-----------------------|---------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| A5 | PLANNER | W7 FIP MULTISTRATÉGIA | 0,63 | -0,14 | -0,14 | -1,31 | 2.855.077,04 | 1,23 | 123.137.486,24 | 2,32 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 0,63 | -0,14 | -0,14 | 19,84 | 2.855.077,04 | 1,23 | | |

| | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|--------------|--------------|--------------|----------------------|-------------|--|--|
| Investimentos Estruturados | | | 13,89 | -0,22 | -3,71 | 18,26 | 15.786.896,67 | 6,79 | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|--------------|--------------|--------------|----------------------|-------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,99%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------|-------------|-------------------------------|------------------------|-------------------|--------------|---------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| LEGATUS | BTG PACTUAL | FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 68,60 | -0,07 | -0,07 | 103,14 | 1.497.275,12 | 0,64 | 314.249.684,12 | 0,48 |
| PLANNER | PLANNER | CARE11 | 34,10 | 2,91 | -6,84 | -37,23 | 799.353,24 | 0,34 | 0,00 | |
| Sub-total Artigo 11º | | | 32,40 | 0,94 | -2,54 | -31,02 | 2.296.628,36 | 0,99 | | |
| Fundos Imobiliários | | | 32,40 | 0,94 | -2,54 | -31,02 | 2.296.628,36 | 0,99 | | |
| Total | | | 1,88 | 0,12 | -0,03 | 9,62 | 232.616.176,25 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | | |
|-----------------------------------|---|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 85.726.776,28 | 36,85 | 0,00 | 55,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 80.689.048,21 | 34,69 | 0,00 | 9,51 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 32.871.941,54 | 14,13 | 0,00 | 14,23 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 1.396.813,06 | 0,60 | 0,00 | 0,77 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 200.684.579,09 | 86,27 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 4.511.474,68 | 1,94 | 0,00 | 0,49 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| | Total Renda Variável | 4.511.474,68 | 1,94 | | | | | 30,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 9.336.597,45 | 4,01 | 0,00 | 10,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 9.336.597,45 | 4,01 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 12.931.819,63 | 5,56 | 0,00 | 7,92 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 2.855.077,04 | 1,23 | 0,00 | 2,08 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 15.786.896,67 | 6,79 | | | | | 15,00 |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 2.296.628,36 | 0,99 | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Fundos Imobiliários | 2.296.628,36 | 0,99 | | | | | 5,00 |
| Total | | 232.616.176,25 | 100,00 | | | | | |