

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

85,49%

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%) | 1,52 | 0,04 | 0,88 | 4,73 | 583.185,02 | 0,22 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,790000%) | 1,36 | 0,04 | 0,88 | 4,74 | 10.135.019,20 | 3,81 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,820000%) | 1,77 | 0,04 | 0,88 | 4,76 | 533.241,78 | 0,20 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (6,030000%) | 4,14 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 17.410,34 | 0,01 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,680000%) | 0,81 | 0,04 | 0,87 | 4,70 | 10.726.420,29 | 4,03 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (6,030000%) | 4,13 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 34.332,34 | 0,01 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,630000%) | 3,93 | 0,04 | 0,87 | 3,09 | 2.048.243,39 | 0,77 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,640000%) | 2,85 | 0,04 | 0,87 | 4,68 | 19.087.665,88 | 7,18 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,660000%) | 2,86 | 0,04 | 0,87 | 4,69 | 8.293.653,75 | 3,12 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,670000%) | 2,87 | 0,04 | 0,87 | 4,69 | 22.405.479,35 | 8,43 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,730000%) | 3,98 | 0,04 | 0,87 | 1,97 | 5.826.303,29 | 2,19 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,770000%) | 4,00 | -0,02 | 0,88 | 1,82 | 7.533.569,47 | 2,83 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,820000%) | 1,30 | 0,04 | 0,88 | 4,76 | 5.357.098,11 | 2,01 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,930000%) | 3,23 | 0,04 | 0,89 | 4,80 | 6.420.361,96 | 2,41 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (6,070000%) | 4,16 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 1.693.986,28 | 0,64 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Ano | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,760000%) | 0,65 | 0,04 | 0,88 | 4,73 | 43.043.390,50 | 16,19 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,790000%) | 1,00 | 0,04 | 0,88 | 4,74 | 10.753.776,85 | 4,04 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (6,070000%) | 4,15 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 102.457,95 | 0,04 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,83 | 0,04 | 0,87 | 4,72 | 154.595.595,75 | 58,15 |

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 IMA-B 5 LP FIC FI | 1,74 | 0,10 | 1,03 | 2,82 | 10.853.439,05 | 4,08 | 5.119.005.015,74 | 0,21 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,73 | 0,10 | 1,03 | 2,83 | 12.517.279,25 | 4,71 | 7.617.915.472,63 | 0,16 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,33 | 0,06 | 0,76 | 3,85 | 21.565.544,24 | 8,11 | 8.395.304.184,88 | 0,26 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,11 | 0,08 | 0,90 | 3,21 | 44.936.262,54 | 16,90 | | |

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 FLUXO FIC | 0,07 | 0,03 | 0,75 | 3,97 | 39.019,09 | 0,01 | 4.168.595.178,55 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B | 3,89 | 0,24 | 1,29 | -0,30 | 10.524.183,99 | 3,96 | 895.169.054,72 | 1,18 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,07 | 0,04 | 0,83 | 4,42 | 5.595.797,95 | 2,10 | 17.741.520.962,30 | 0,03 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 1,91 | 0,15 | 0,86 | 2,02 | 10.277.236,20 | 3,87 | 732.663.879,16 | 1,40 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 2,20 | 0,16 | 1,03 | 1,57 | 26.436.237,23 | 9,94 | | |

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 | 4,77 | -0,20 | -0,20 | -4,20 | 1.329.935,60 | 0,50 | 119.768.322,83 | 1,11 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | | | 4,77 | -0,20 | -0,20 | -4,20 | 1.329.935,60 | 0,50 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,85

0,06

0,89

3,95

227.298.031,12

85,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,81%

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 | 15,61 | -1,05 | -2,32 | -6,76 | 4.812.562,36 | 1,81 | 662.355.219,68 | 0,73 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 15,61 | -1,05 | -2,32 | -6,76 | 4.812.562,36 | 1,81 | | |
| Renda Variável | | | 15,39 | -1,05 | -2,32 | -6,76 | 4.812.562,36 | 1,81 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,68%

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 | 13,53 | -0,46 | 6,78 | 23,76 | 12.438.549,99 | 4,68 | 2.462.872.316,84 | 0,51 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 13,53 | -0,46 | 6,78 | 23,76 | 12.438.549,99 | 4,68 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 13,53 | -0,46 | 6,78 | 23,76 | 12.438.549,99 | 4,68 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,77%

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 | 11,35 | 0,16 | 5,07 | 12,32 | 16.411.421,91 | 6,17 | 1.884.343.751,95 | 0,87 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 11,35 | 0,16 | 5,07 | 12,32 | 16.411.421,91 | 6,17 | | |

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 | 57,84 | -0,13 | -0,13 | -44,11 | 1.589.008,49 | 0,60 | 68.532.830,13 | 2,32 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 57,84 | -0,13 | -0,13 | -44,11 | 1.589.008,49 | 0,60 | | |

| | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|
| Investimentos Estruturados | | | 11,59 | 0,13 | 4,59 | 3,13 | 18.000.430,40 | 6,77 | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,25%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------|-------------|-------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| PLANNER | PLANNER | CARE11 | 43,02 | 0,00 | -1,59 | 35,77 | 839.998,32 | 0,32 | 0,00 | |
| LEGATUS | BTG PACTUAL | FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 62,52 | -0,02 | -0,02 | -10,12 | 2.482.842,30 | 0,93 | 653.383.873,16 | 0,38 |
| Sub-total Artigo 11º | | | 49,13 | -0,01 | -0,42 | -1,72 | 3.322.840,62 | 1,25 | | |
| Fundos Imobiliários | | | 49,13 | -0,01 | -0,42 | -1,72 | 3.322.840,62 | 1,25 | | |
| Total | | | 1,74 | 0,02 | 1,32 | 4,39 | 265.872.414,49 | 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 | 154.595.595,75 | 58,15 | 0,00 | 60,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 44.936.262,54 | 16,90 | 0,00 | 8,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 26.436.237,23 | 9,94 | 0,00 | 10,00 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 1.329.935,60 | 0,50 | 0,00 | 0,65 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 227.298.031,12 | 85,49 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 4.812.562,36 | 1,81 | 0,00 | 2,50 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| | Total Renda Variável | 4.812.562,36 | 1,81 | | | | | 30,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 12.438.549,99 | 4,68 | 0,00 | 5,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 12.438.549,99 | 4,68 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 16.411.421,91 | 6,17 | 0,00 | 6,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 1.589.008,49 | 0,60 | 0,00 | 1,35 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 18.000.430,40 | 6,77 | | | | | 15,00 |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 3.322.840,62 | 1,25 | 0,00 | 1,50 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Fundos Imobiliários | 3.322.840,62 | 1,25 | | | | | 5,00 |
| Total | | 265.872.414,49 | 100,00 | | | | | |