

## FUNDAÇÃO ASSISTENCIAL DOS EMPREGADOS DA CESAN-FAECES

## DEMONSTRATIVO DOS INVESTIMENTOS DO PRIMEIRO SEMESTRE DE 2021

| PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO                                   | MÊS 01/2021   |                       | MÊS 02/2021   |                       | MÊS 03/2021   |                       | MÊS 04/2021   |                       | MÊS 05/2021   |                       | MÊS 06/2021   |                       |
|---|---------------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|-----------------------|
|   | % SOBRE       | VALOR                 | % SOBRE       | VALOR                 | % SOBRE       | VALOR                 | % SOBRE       | VALOR                 | % SOBRE       | VALOR                 | % SOBRE       | VALOR                 |
|   | TOT.APLIC.    | APLICADO (R\$)        | TOT.APLIC.    | APLICADO (R\$)        | TOT.APLIC.    | APLICADO (R\$)        | TOT.APLIC.    | APLICADO (R\$)        | TOT.APLIC.    | APLICADO (R\$)        | TOT.APLIC.    | APLICADO (R\$)        |
| <b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>                                       | <b>1,10%</b>  | <b>3.958.317,99</b>   | <b>1,09%</b>  | <b>3.925.777,30</b>   | <b>1,05%</b>  | <b>3.825.157,61</b>   | <b>1,04%</b>  | <b>3.760.704,99</b>   | <b>1,01%</b>  | <b>3.720.355,08</b>   | <b>0,95%</b>  | <b>3.649.717,84</b>   |
| IMOBILIÁRIO   | 0,21%         | 741.000,00            | 0,21%         | 741.000,00            | 0,20%         | 741.000,00            | 0,20%         | 741.000,00            | 0,20%         | 741.000,00            | 0,19%         | 741.000,00            |
| OPER PARTICIPANTES  | 0,89%         | 3.213.317,99          | 0,89%         | 3.184.777,30          | 0,85%         | 3.084.157,61          | 0,83%         | 3.019.704,99          | 0,81%         | 2.979.355,08          | 0,76%         | 2.908.717,84          |
| <b>RENDA FIXA</b>   | <b>50,79%</b> | <b>183.063.978,69</b> | <b>50,60%</b> | <b>181.905.315,12</b> | <b>50,92%</b> | <b>185.027.209,50</b> | <b>51,51%</b> | <b>186.823.411,56</b> | <b>50,64%</b> | <b>185.937.140,93</b> | <b>54,12%</b> | <b>208.396.401,65</b> |
| TÍTULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/05/2023 - QUANT. 10.682.000 | 10,27%        | 37.005.334,77         | 10,38%        | 37.305.529,53         | 10,45%        | 37.957.888,35         | 10,57%        | 38.337.010,26         | 10,25%        | 37.619.559,95         | 9,90%         | 38.104.698,90         |
| TÍTULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/08/2028 - QUANT. 6.457.000  | 6,44%         | 23.197.887,90         | 6,32%         | 22.713.898,75         | 6,36%         | 23.097.946,60         | 6,43%         | 23.317.106,64         | 6,41%         | 23.549.721,90         | 6,19%         | 23.841.026,44         |
| TÍTULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/08/2030 - QUANT. 9.017.000  | 8,99%         | 32.413.321,43         | 8,83%         | 31.738.420,76         | 8,88%         | 32.276.122,68         | 8,98%         | 32.583.304,57         | 8,96%         | 32.909.354,24         | 8,65%         | 33.317.440,89         |
| TÍTULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/05/2035 - QUANT. 10.030.000 | 9,36%         | 33.734.303,97         | 9,46%         | 34.007.686,55         | 9,52%         | 34.602.027,00         | 9,64%         | 34.947.333,87         | 9,33%         | 34.262.334,88         | 11,11%        | 42.770.866,08         |
| TÍTULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/08/2040 - QUANT. 7.857.000  | 7,90%         | 28.460.171,73         | 7,75%         | 27.873.881,35         | 7,80%         | 28.346.265,87         | 7,89%         | 28.616.181,57         | 7,87%         | 28.902.677,33         | 9,05%         | 34.841.748,97         |
| TÍTULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/05/2045 - QUANT. 5.928.000  | 5,83%         | 21.027.670,56         | 5,89%         | 21.190.565,02         | 5,93%         | 21.551.133,80         | 6,00%         | 21.757.616,68         | 5,82%         | 21.355.356,72         | 6,84%         | 26.327.448,80         |
| TÍTULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/08/2050 - QUANT. 2.010.000  | 2,00%         | 7.075.288,33          | 1,97%         | 7.075.333,16          | 1,98%         | 7.195.825,20          | 2,00%         | 7.264.857,97          | 2,00%         | 7.338.135,91          | 2,39%         | 9.193.171,57          |
| <b>FUNDOS</b>   | <b>48,11%</b> | <b>173.376.299,67</b> | <b>48,30%</b> | <b>173.637.754,69</b> | <b>48,03%</b> | <b>174.508.425,54</b> | <b>47,45%</b> | <b>172.115.335,54</b> | <b>48,35%</b> | <b>177.535.735,76</b> | <b>43,63%</b> | <b>173.026.650,04</b> |
| <b>RENDA FIXA</b>   | <b>14,00%</b> | <b>50.451.357,04</b>  | <b>14,19%</b> | <b>51.006.030,33</b>  | <b>13,35%</b> | <b>48.497.326,71</b>  | <b>14,15%</b> | <b>51.329.098,44</b>  | <b>14,38%</b> | <b>52.802.117,35</b>  | <b>12,71%</b> | <b>48.934.995,23</b>  |
| KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FIM                                   | 2,73%         | 9.853.306,44          | 3,54%         | 12.720.027,93         | 4,06%         | 14.738.081,14         | 4,16%         | 15.097.252,23         | 4,21%         | 15.468.330,25         | 3,00%         | 11.540.285,43         |
| VINCI VALOREM FIM   | 6,24%         | 22.496.124,16         | 6,23%         | 22.408.605,22         | 5,72%         | 20.766.144,06         | 6,19%         | 22.462.367,61         | 6,41%         | 23.552.652,09         | 6,11%         | 23.528.059,34         |
| CLARITAS INSTITUCIONAL FIM                                    | 0,60%         | 2.179.249,63          | 0,07%         | 251.364,91            | 0,03%         | 106.896,43            | 0,03%         | 107.118,02            | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| FIDC MULT. SILVERADO MAXIMUM - 7ª SÉRIE                       | 0,04%         | 154.464,70            | 0,04%         | 154.464,70            | 0,04%         | 154.464,70            | 0,04%         | 154.464,70            | 0,04%         | 154.464,70            | 0,04%         | 154.464,70            |
| ICATU VANGUARDA FIC FI INFL. LONGA RF                         | 1,44%         | 5.203.003,89          | 1,41%         | 5.079.604,41          | 1,41%         | 5.130.379,18          | 2,12%         | 7.700.566,32          | 2,12%         | 7.800.757,67          | 2,04%         | 7.861.756,87          |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INST TP RF LP                          | 1,45%         | 5.232.019,09          | 1,43%         | 5.151.876,11          | 1,41%         | 5.126.869,21          | 1,42%         | 5.159.037,91          | 1,42%         | 5.212.095,92          | 1,36%         | 5.232.849,02          |
| BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA                             | 1,48%         | 5.333.189,13          | 1,46%         | 5.240.087,05          | 0,68%         | 2.474.491,99          | 0,18%         | 648.291,65            | 0,17%         | 613.816,72            | 0,16%         | 617.579,87            |
| <b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>                              | <b>0,00%</b>  | <b>-</b>              | <b>0,00%</b>  | <b>-</b>              | <b>0,00%</b>  | <b>-</b>              | <b>0,00%</b>  | <b>-</b>              | <b>0,00%</b>  | <b>-</b>              | <b>1,30%</b>  | <b>5.022.567,79</b>   |
| JP MORGAN GLOBAL MACRO OPPORT MASTER FIM-IE                   | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,52%         | 2.020.892,37          |
| MAG GLOBAL SUSTAINABLE FIM-IE                                 | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,78%         | 3.001.675,42          |
| <b>RENDA VARIÁVEL</b>   | <b>16,23%</b> | <b>58.505.988,49</b>  | <b>15,72%</b> | <b>56.504.586,19</b>  | <b>16,21%</b> | <b>58.902.092,28</b>  | <b>16,58%</b> | <b>60.133.026,15</b>  | <b>17,37%</b> | <b>63.776.671,77</b>  | <b>16,78%</b> | <b>64.616.464,39</b>  |
| MOAT CAPITAL FIA  | 2,81%         | 10.123.090,62         | 2,65%         | 9.519.898,31          | 2,78%         | 10.112.972,86         | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                                | 1,96%         | 7.056.152,21          | 1,89%         | 6.787.647,64          | 1,96%         | 7.131.441,56          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA                             | 0,67%         | 2.419.151,30          | 0,65%         | 2.326.855,35          | 0,67%         | 2.444.782,78          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA                                     | 2,75%         | 9.917.995,01          | 2,69%         | 9.663.400,74          | 2,90%         | 10.530.613,89         | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| BB AÇÕES EQUIDADE FIA   | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,74%         | 2.667.386,06          | 0,78%         | 2.875.654,13          | 0,75%         | 2.881.543,97          |
| ITAU AÇÕES DIVIDENDOS FIA                                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,90%         | 3.253.293,87          | 0,93%         | 3.430.219,29          | 0,87%         | 3.357.967,39          |
| ARX INCOME FIA  | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,89%         | 3.231.561,67          | 0,93%         | 3.402.352,24          | 0,89%         | 3.414.062,24          |
| GUEPARDO INSTITUCIONAL FIA                                    | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 1,20%         | 4.343.559,76          | 1,34%         | 4.908.828,86          | 1,34%         | 5.144.729,66          |
| ITAU MOMENTO 30 FIC FIA                                       | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,74%         | 2.696.203,04          | 0,77%         | 2.817.371,80          | 0,74%         | 2.868.041,15          |
| ITAU OLIMPO FIC FIA   | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,74%         | 2.687.898,64          | 0,77%         | 2.824.149,66          | 0,74%         | 2.864.485,36          |
| JGP LONG LONG INSTITUCIONAL FIC FIA                           | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 1,23%         | 4.469.401,46          | 1,29%         | 4.739.555,27          | 1,26%         | 4.853.112,09          |
| PACÍFICO AÇÕES FIC FIA  | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 1,22%         | 4.428.498,99          | 1,24%         | 4.570.971,02          | 1,19%         | 4.582.356,18          |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIA                               | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 1,25%         | 4.547.921,62          | 1,29%         | 4.732.879,55          | 1,27%         | 4.876.195,57          |
| SAFRA MULTIDIVIDENDOS   | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,90%         | 3.249.129,52          | 0,93%         | 3.415.396,14          | 0,87%         | 3.364.150,43          |
| FATOR AÇÕES FIC FIA   | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,74%         | 2.675.127,71          | 0,79%         | 2.895.801,96          | 0,78%         | 2.988.380,13          |
| HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIA                                 | 1,85%         | 6.677.237,81          | 1,79%         | 6.424.762,14          | 1,83%         | 6.633.676,25          | 1,83%         | 6.647.288,77          | 1,97%         | 7.241.486,58          | 1,90%         | 7.324.264,85          |
| SHARP IBOVESPA ATIVO FIA                                      | 1,92%         | 6.915.164,65          | 1,83%         | 6.595.682,38          | 1,89%         | 6.882.221,73          | 1,95%         | 7.067.041,47          | 2,01%         | 7.370.862,25          | 1,92%         | 7.408.467,74          |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                            | 2,09%         | 7.522.802,42          | 2,11%         | 7.583.688,74          | 2,10%         | 7.639.181,38          | 2,25%         | 8.168.713,57          | 2,33%         | 8.551.143,02          | 2,26%         | 8.688.707,63          |
| NEO NAVITAS FIC FIA   | 2,18%         | 7.874.394,47          | 2,11%         | 7.602.650,89          | 2,07%         | 7.527.201,83          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| <b>ESTRUTURADO (MULTIMERCADO)</b>                             | <b>6,31%</b>  | <b>22.756.395,05</b>  | <b>6,35%</b>  | <b>22.828.599,78</b>  | <b>7,04%</b>  | <b>25.585.351,68</b>  | <b>6,37%</b>  | <b>23.097.145,65</b>  | <b>6,34%</b>  | <b>23.269.133,52</b>  | <b>6,09%</b>  | <b>23.462.900,23</b>  |
| BAHIA AM MARAU FIC FIM  | 0,49%         | 1.753.797,03          | 0,49%         | 1.761.704,55          | 0,49%         | 1.764.576,89          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC FIM                            | 0,49%         | 1.761.318,29          | 0,49%         | 1.769.241,30          | 0,49%         | 1.772.110,60          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| NOVUS CAPITAL MACRO FIC FIM                                   | 0,97%         | 3.486.497,83          | 0,97%         | 3.479.191,35          | 0,97%         | 3.520.308,17          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| AZ QUEST MULTI FIC de FIM                                     | 0,97%         | 3.490.460,69          | 0,97%         | 3.469.924,35          | 0,96%         | 3.501.405,95          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| ABSOLUTE EP ALPHA GLOBAL FIC FIM                              | 0,58%         | 2.087.602,30          | 0,58%         | 2.091.586,11          | 0,58%         | 2.097.978,40          | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     |
| GÁVEA MACRO II FIC FIM  | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,79%         | 2.869.360,05          | 0,78%         | 2.879.340,89          | 0,75%         | 2.897.864,43          |
| NEO MULTISTRATÉGIA 30 FEEDER                                  | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,79%         | 2.882.008,52          | 0,78%         | 2.862.612,06          | 0,76%         | 2.933.790,59          |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FI                                 | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,79%         | 2.870.372,28          | 0,78%         | 2.869.777,12          | 0,75%         | 2.875.367,87          |
| SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC FIM                                | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,00%         | -                     | 0,80%         | 2.914.513,36          | 0,79%         | 2.897.750,35          | 0,75%         | 2.906.493,74          |
| IBIUNA HEDGE STH FIC  | 0,70%         | 2.511.360,46          | 0,72%         | 2.594.920,01          | 0,72%         | 2.625.200,91          | 0,72%         | 2.615.292,72          | 0,71%         | 2.623.708,42          | 0,69%         | 2.638.887,43          |
| MOAT CAPITAL EQUITY HEDGE FIC FIM                             | 1,06%         | 3.835.387,05          | 1,06%         | 3.827.696,89          | 1,07%         | 3.896.123,47          | 1,06%         | 3.855.368,11          | 1,08%         | 3.950.374,55          | 1,03%         | 3.969.411,50          |

FUNDAÇÃO ASSISTENCIAL DOS EMPREGADOS DA CESAN-FAECES

DEMONSTRATIVO DOS INVESTIMENTOS DO PRIMEIRO SEMESTRE DE 2021

|  | MÊS 01/2021               |                             | MÊS 02/2021               |                             | MÊS 03/2021               |                             | MÊS 04/2021               |                             | MÊS 05/2021               |                             | MÊS 06/2021               |                             |
|--|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|
| ITAÚ HEDGE PLUS MM FIC                                       | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,70%                     | 2.542.279,30                | 0,70%                     | 2.534.409,75                | 0,71%                     | 2.591.574,18                | 0,67%                     | 2.597.708,42                |
| GAP ABSOLUTO FIM   | 0,70%                     | 2.515.490,60                | 0,70%                     | 2.521.116,05                | 0,71%                     | 2.564.831,09                | 0,70%                     | 2.555.820,86                | 0,71%                     | 2.593.995,95                | 0,69%                     | 2.643.376,25                |
| BTG PACTUAL DISCOVERY FIM                                    | 0,36%                     | 1.314.480,80                | 0,37%                     | 1.313.219,17                | 0,36%                     | 1.300.536,90                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| <b>ESTRUTURADO (PARTICIPAÇÕES)</b>                           | <b>11,56%</b>             | <b>41.662.559,09</b>        | <b>12,05%</b>             | <b>43.298.538,39</b>        | <b>11,43%</b>             | <b>41.523.654,87</b>        | <b>10,35%</b>             | <b>37.556.065,30</b>        | <b>10,26%</b>             | <b>37.687.813,12</b>        | <b>8,05%</b>              | <b>30.989.722,40</b>        |
| FIP - LACAN FLORESTAL  | 3,63%                     | 13.081.875,77               | 3,81%                     | 13.705.759,89               | 3,53%                     | 12.828.419,82               | 3,53%                     | 12.819.011,49               | 3,49%                     | 12.809.870,64               | 3,32%                     | 12.800.669,44               |
| FIP MALBEC (STO ANTONIO) + PUT MALBEC                        | 4,84%                     | 17.442.925,67               | 4,90%                     | 17.613.580,65               | 4,49%                     | 16.325.172,60               | 3,85%                     | 13.979.191,07               | 3,85%                     | 14.143.320,10               | 2,62%                     | 10.089.655,62               |
| FIP COPA FLORESTAL III                                       | 0,85%                     | 3.067.884,75                | 0,83%                     | 2.979.981,51                | 0,82%                     | 2.977.564,95                | 0,83%                     | 3.024.107,03                | 0,82%                     | 3.021.612,03                | 0,11%                     | 405.943,00                  |
| BTG PACTUAL ECONOMIA REAL                                    | 0,62%                     | 2.224.088,28                | 0,62%                     | 2.218.524,79                | 0,75%                     | 2.711.661,23                | 0,74%                     | 2.698.238,63                | 0,73%                     | 2.683.709,72                | 0,69%                     | 2.669.593,21                |
| BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II                                | 1,62%                     | 5.845.784,62                | 1,89%                     | 6.780.691,55                | 1,84%                     | 6.680.836,27                | 1,39%                     | 5.035.517,08                | 1,37%                     | 5.029.300,63                | 1,30%                     | 5.023.861,13                |
| <b>TOTAL PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO</b>                     | <b>100,00%</b>            | <b>360.398.596,35</b>       | <b>100,00%</b>            | <b>359.468.847,11</b>       | <b>100,00%</b>            | <b>363.360.792,65</b>       | <b>100,00%</b>            | <b>362.699.452,09</b>       | <b>100,00%</b>            | <b>367.193.231,77</b>       | <b>100,00%</b>            | <b>385.072.769,53</b>       |
|  |                           |                             |                           |                             |                           |                             |                           |                             |                           |                             |                           |                             |
| <b>PLANO DE BENEFÍCIOS II</b>                                | <b>% SOBRE TOT.APLIC.</b> | <b>VALOR APLICADO (R\$)</b> | <b>% SOBRE TOT.APLIC.</b> | <b>VALOR APLICADO (R\$)</b> | <b>% SOBRE TOT.APLIC.</b> | <b>VALOR APLICADO (R\$)</b> | <b>% SOBRE TOT.APLIC.</b> | <b>VALOR APLICADO (R\$)</b> | <b>% SOBRE TOT.APLIC.</b> | <b>VALOR APLICADO (R\$)</b> | <b>% SOBRE TOT.APLIC.</b> | <b>VALOR APLICADO (R\$)</b> |
| <b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>                                      | <b>2,16%</b>              | <b>1.240.969,99</b>         | <b>2,11%</b>              | <b>1.234.477,92</b>         | <b>2,02%</b>              | <b>1.198.607,67</b>         | <b>1,96%</b>              | <b>1.181.904,78</b>         | <b>1,85%</b>              | <b>1.136.608,08</b>         | <b>1,82%</b>              | <b>1.127.164,12</b>         |
| OPER PARTICIPANTES   | 2,16%                     | 1.240.969,99                | 2,11%                     | 1.234.477,92                | 2,02%                     | 1.198.607,67                | 1,96%                     | 1.181.904,78                | 1,85%                     | 1.136.608,08                | 1,82%                     | 1.127.164,12                |
| <b>RENDA FIXA</b>  | <b>21,46%</b>             | <b>12.325.171,45</b>        | <b>21,25%</b>             | <b>12.420.757,26</b>        | <b>21,28%</b>             | <b>12.632.241,80</b>        | <b>21,18%</b>             | <b>12.753.393,96</b>        | <b>20,37%</b>             | <b>12.517.916,32</b>        | <b>20,46%</b>             | <b>12.674.110,02</b>        |
| TITULOS PÚBLICOS (NTN-B) VENC. 15/05/2055 - QUANT. 3.473.000 | 21,46%                    | 12.325.171,45               | 21,25%                    | 12.420.757,26               | 21,28%                    | 12.632.241,80               | 21,18%                    | 12.753.393,96               | 20,37%                    | 12.517.916,32               | 20,46%                    | 12.674.110,02               |
| <b>FUNDOS</b>  | <b>76,38%</b>             | <b>43.877.655,41</b>        | <b>76,64%</b>             | <b>44.797.445,38</b>        | <b>76,70%</b>             | <b>45.541.572,39</b>        | <b>76,85%</b>             | <b>46.273.120,05</b>        | <b>77,78%</b>             | <b>47.802.321,21</b>        | <b>74,47%</b>             | <b>46.118.573,15</b>        |
| <b>RENDA FIXA</b>  | <b>43,95%</b>             | <b>25.245.022,27</b>        | <b>44,03%</b>             | <b>25.735.813,21</b>        | <b>43,15%</b>             | <b>25.619.744,43</b>        | <b>44,29%</b>             | <b>26.665.950,04</b>        | <b>45,18%</b>             | <b>27.769.156,83</b>        | <b>42,46%</b>             | <b>26.298.553,37</b>        |
| BRDESCO H FIC DE FIM LP MACRO INSTIT.                        | 5,45%                     | 3.129.421,40                | 5,32%                     | 3.108.432,64                | 6,30%                     | 3.739.238,45                | 6,25%                     | 3.763.926,08                | 6,15%                     | 3.777.885,40                | 2,55%                     | 1.580.451,20                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI               | 2,59%                     | 1.489.636,05                | 2,51%                     | 1.467.525,78                | 2,48%                     | 1.469.646,99                | 2,44%                     | 1.471.225,91                | 2,40%                     | 1.475.210,59                | 2,39%                     | 1.479.435,38                |
| OCCAM INSTITUCIONAL FIC FIM II                               | 4,61%                     | 2.648.249,09                | 4,55%                     | 2.659.763,07                | 4,49%                     | 2.665.211,27                | 4,44%                     | 2.671.136,98                | 4,35%                     | 2.675.339,15                | 4,33%                     | 2.681.699,75                |
| KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FIM                                  | 8,60%                     | 4.938.978,74                | 9,52%                     | 5.564.039,34                | 11,43%                    | 6.787.757,17                | 12,20%                    | 7.345.424,86                | 12,94%                    | 7.950.006,72                | 13,96%                    | 8.642.923,81                |
| VINCI VALOREM FIM  | 10,37%                    | 5.954.338,92                | 10,15%                    | 5.931.174,16                | 11,10%                    | 6.589.761,89                | 10,98%                    | 6.608.062,77                | 11,50%                    | 7.067.261,88                | 11,40%                    | 7.059.882,52                |
| CLARITAS INSTITUCIONAL FIM                                   | 2,62%                     | 1.502.223,36                | 2,57%                     | 1.503.085,95                | 2,11%                     | 1.250.693,13                | 2,08%                     | 1.253.285,69                | 1,99%                     | 1.223.726,37                | 1,98%                     | 1.227.195,39                |
| NOVUS CAPITAL INSTITUCIONAL FIC FIM                          | 3,25%                     | 1.866.754,40                | 3,19%                     | 1.864.297,04                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| ICATU VANGUARDA FIC FI INFL. LONGA RF                        | 3,63%                     | 2.087.040,52                | 3,49%                     | 2.037.542,25                | 4,28%                     | 2.544.068,32                | 5,02%                     | 3.021.599,22                | 4,98%                     | 3.060.912,97                | 4,98%                     | 3.084.848,24                |
| BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA                            | 2,83%                     | 1.628.379,79                | 2,74%                     | 1.599.952,98                | 0,97%                     | 573.367,21                  | 0,88%                     | 531.288,53                  | 0,88%                     | 538.813,75                  | 0,88%                     | 542.117,08                  |
| <b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>                             | <b>0,00%</b>              | <b>-</b>                    | <b>0,00%</b>              | <b>-</b>                    | <b>0,00%</b>              | <b>-</b>                    | <b>0,00%</b>              | <b>-</b>                    | <b>0,00%</b>              | <b>-</b>                    | <b>3,25%</b>              | <b>2.011.004,66</b>         |
| JP MORGAN GLOBAL MACRO OPPORT MASTER FIM-IE                  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 1,63%                     | 1.010.446,19                |
| MAG GLOBAL SUSTAINABLE FIM-IE                                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 1,62%                     | 1.000.558,47                |
| <b>RENDA VARIÁVEL</b>  | <b>16,02%</b>             | <b>9.202.857,06</b>         | <b>15,26%</b>             | <b>8.918.939,70</b>         | <b>15,68%</b>             | <b>9.307.273,53</b>         | <b>15,89%</b>             | <b>9.564.959,46</b>         | <b>16,51%</b>             | <b>10.146.061,24</b>        | <b>16,65%</b>             | <b>10.310.649,56</b>        |
| CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA                                    | 4,21%                     | 2.419.474,63                | 4,03%                     | 2.357.366,88                | 4,33%                     | 2.568.921,75                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| MOAT CAPITAL FIA   | 2,31%                     | 1.328.722,66                | 2,14%                     | 1.249.549,68                | 2,24%                     | 1.327.394,64                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                               | 1,54%                     | 886.369,04                  | 1,46%                     | 852.640,44                  | 1,51%                     | 895.826,62                  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| NEO NAVITAS FIC FIA  | 2,61%                     | 1.501.671,72                | 2,48%                     | 1.449.849,37                | 2,42%                     | 1.435.461,00                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| BB AÇÕES EQUIDADE FIA  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 2,17%                     | 1.307.147,06                | 2,29%                     | 1.409.208,40                | 2,28%                     | 1.412.094,70                |
| ARX INCOME FIA   | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,74%                     | 446.139,44                  | 0,76%                     | 469.718,26                  | 0,76%                     | 471.334,91                  |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIA                              | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 2,38%                     | 1.430.068,69                | 2,42%                     | 1.488.227,68                | 2,48%                     | 1.533.292,61                |
| SAFRA MULTIDIVIDENDOS  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,75%                     | 449.023,88                  | 0,77%                     | 472.001,63                  | 0,75%                     | 464.919,56                  |
| JGP LONG LONG INSTITUCIONAL FIC FIA                          | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 2,33%                     | 1.405.378,46                | 2,42%                     | 1.490.326,82                | 2,46%                     | 1.526.034,13                |
| FATOR AÇÕES FIC FIA  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 2,20%                     | 1.322.413,72                | 2,33%                     | 1.431.501,09                | 2,39%                     | 1.477.265,87                |
| SHARP IBOVESPA ATIVO FIA                                     | 1,46%                     | 839.571,84                  | 1,37%                     | 800.783,42                  | 1,41%                     | 835.572,23                  | 1,43%                     | 858.011,24                  | 1,46%                     | 894.898,20                  | 1,45%                     | 899.463,89                  |
| HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIA                                | 1,38%                     | 791.243,73                  | 1,30%                     | 761.325,70                  | 1,32%                     | 786.081,74                  | 1,31%                     | 787.694,81                  | 1,40%                     | 858.106,45                  | 1,40%                     | 867.915,57                  |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                           | 2,50%                     | 1.435.803,44                | 2,48%                     | 1.447.424,21                | 2,46%                     | 1.458.015,55                | 2,59%                     | 1.559.082,16                | 2,66%                     | 1.632.072,71                | 2,68%                     | 1.658.328,32                |
| <b>ESTRUTURADO (MULTIMERCADO)</b>                            | <b>5,60%</b>              | <b>3.216.267,49</b>         | <b>5,52%</b>              | <b>3.228.865,53</b>         | <b>6,27%</b>              | <b>3.722.566,88</b>         | <b>5,74%</b>              | <b>3.453.475,71</b>         | <b>5,35%</b>              | <b>3.287.701,62</b>         | <b>5,35%</b>              | <b>3.315.613,24</b>         |
| NOVUS CAPITAL MACRO FIC FIM                                  | 1,89%                     | 1.086.281,73                | 1,85%                     | 1.084.137,33                | 1,85%                     | 1.096.949,58                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| BAHIA AM MARAU FIC FIM                                       | 0,23%                     | 131.534,78                  | 0,23%                     | 132.127,84                  | 0,22%                     | 132.343,27                  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC FIM                           | 0,70%                     | 401.313,03                  | 0,69%                     | 403.118,27                  | 0,68%                     | 403.772,03                  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FIC FIM                                | 0,91%                     | 520.029,56                  | 0,89%                     | 521.027,67                  | 0,88%                     | 522.635,47                  | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           |
| GÁVEA MACRO II FIC FIM                                       | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,78%                     | 469.895,20                  | 0,77%                     | 471.529,69                  | 0,77%                     | 474.563,16                  |
| NEO MULTISTRATÉGIA 30 FEEDER                                 | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,78%                     | 471.966,55                  | 0,76%                     | 468.790,13                  | 0,78%                     | 480.446,54                  |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FI                                | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,78%                     | 470.060,97                  | 0,76%                     | 469.963,50                  | 0,76%                     | 470.879,06                  |
| SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC FIM                               | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,00%                     | -                           | 0,80%                     | 478.682,09                  | 0,77%                     | 475.928,92                  | 0,77%                     | 477.364,94                  |
| IBIUNA HEDGE STH FIC   | 0,59%                     | 336.885,97                  | 0,60%                     | 348.095,05                  | 0,59%                     | 352.157,08                  | 0,58%                     | 350.827,94                  | 0,57%                     | 351.956,87                  | 0,57%                     | 353.993,05                  |
| MOAT CAPITAL EQUITY HEDGE FIC FIM                            | 0,38%                     | 219.964,85                  | 0,38%                     | 219.523,81                  | 0,38%                     | 223.448,17                  | 0,37%                     | 221.110,79                  | 0,37%                     | 226.559,54                  | 0,37%                     | 227.651,34                  |

**FUNDAÇÃO ASSISTENCIAL DOS EMPREGADOS DA CESAN-FAECES**

**DEMONSTRATIVO DOS INVESTIMENTOS DO PRIMEIRO SEMESTRE DE 2021**

|   | MÊS 01/2021       |                       | MÊS 02/2021       |                       | MÊS 03/2021       |                       | MÊS 04/2021       |                       | MÊS 05/2021       |                       | MÊS 06/2021       |                       |
|---|-------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| GAP ABSOLUTO FIM                                  | 0,59%             | 337.075,74            | 0,58%             | 337.829,55            | 0,58%             | 343.687,37            | 0,57%             | 342.480,00            | 0,57%             | 347.595,46            | 0,57%             | 354.212,42            |
| ITAÚ HEDGE PLUS MM FIC                            | 0,00%             | -                     | 0,00%             | -                     | 0,79%             | 466.335,26            | 0,77%             | 464.891,73            | 0,77%             | 475.377,51            | 0,77%             | 476.502,73            |
| BTG PACTUAL DISCOVERY FIM                         | 0,32%             | 183.181,83            | 0,31%             | 183.006,01            | 0,31%             | 181.238,65            | 0,30%             | 183.560,44            | 0,00%             | -                     | 0,00%             | -                     |
| <b>ESTRUTURADO (PARTICIPAÇÕES)</b>                | <b>10,82%</b>     | <b>6.213.508,59</b>   | <b>11,83%</b>     | <b>6.913.826,94</b>   | <b>11,61%</b>     | <b>6.891.987,55</b>   | <b>10,94%</b>     | <b>6.588.734,84</b>   | <b>10,74%</b>     | <b>6.599.401,52</b>   | <b>10,00%</b>     | <b>6.193.756,98</b>   |
| FIP - LACAN FLORESTAL II                          | 5,31%             | 3.049.192,08          | 6,10%             | 3.566.672,17          | 6,15%             | 3.648.731,25          | 6,05%             | 3.644.220,18          | 5,92%             | 3.640.086,29          | 6,16%             | 3.813.377,66          |
| FIP - LACAN FLORESTAL III                         | 1,23%             | 705.939,77            | 1,49%             | 868.141,59            | 1,45%             | 863.652,07            | 1,43%             | 859.835,94            | 1,39%             | 855.936,50            | 1,27%             | 785.473,21            |
| BTG PACTUAL ECONOMIA REAL                         | 0,48%             | 278.011,03            | 0,47%             | 277.315,60            | 0,57%             | 338.957,65            | 0,56%             | 337.279,83            | 0,55%             | 335.463,71            | 0,54%             | 333.699,15            |
| FIP MALBEC (STO ANTONIO) + PUT MALBEC             | 3,80%             | 2.180.365,71          | 3,77%             | 2.201.697,58          | 3,44%             | 2.040.646,58          | 2,90%             | 1.747.398,89          | 2,88%             | 1.767.915,02          | 2,04%             | 1.261.206,96          |
| <b>TOTAL PLANO DE BENEFÍCIOS II</b>               | <b>100,00%</b>    | <b>57.443.796,85</b>  | <b>100,00%</b>    | <b>58.452.680,56</b>  | <b>100,00%</b>    | <b>59.372.421,86</b>  | <b>100,00%</b>    | <b>60.208.418,79</b>  | <b>100,00%</b>    | <b>61.456.845,61</b>  | <b>100,00%</b>    | <b>61.930.851,95</b>  |
| <b>PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA (PGA)</b>       | <b>% SOBRE</b>    | <b>VALOR</b>          | <b>% SOBRE</b>    | <b>VALOR</b>          | <b>% SOBRE</b>    | <b>VALOR</b>          | <b>% SOBRE</b>    | <b>VALOR</b>          | <b>% SOBRE</b>    | <b>VALOR</b>          | <b>% SOBRE</b>    | <b>VALOR</b>          |
|   | <b>TOT.APLIC.</b> | <b>APLICADO (R\$)</b> | <b>TOT.APLIC.</b> | <b>APLICADO (R\$)</b> | <b>TOT.APLIC.</b> | <b>APLICADO (R\$)</b> | <b>TOT.APLIC.</b> | <b>APLICADO (R\$)</b> | <b>TOT.APLIC.</b> | <b>APLICADO (R\$)</b> | <b>TOT.APLIC.</b> | <b>APLICADO (R\$)</b> |
| <b>FUNDOS</b>                                     | <b>100,00%</b>    | <b>3.705.116,59</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.724.164,60</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.888.246,53</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.685.144,53</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.714.958,91</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.839.063,34</b>   |
| <b>RENTA FIXA</b>                                 | <b>100,00%</b>    | <b>3.705.116,59</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.724.164,60</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.888.246,53</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.685.144,53</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.714.958,91</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.839.063,34</b>   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI-FI             | 42,33%            | 1.568.291,39          | 43,01%            | 1.601.887,70          | 45,34%            | 1.762.947,62          | 42,18%            | 1.554.392,96          | 100,00%           | 3.714.958,91          | 100,00%           | 3.839.063,34          |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FIM                    | 57,67%            | 2.136.825,20          | 56,99%            | 2.122.276,90          | 54,66%            | 2.125.298,91          | 57,82%            | 2.130.751,57          | 0,00%             | -                     | 0,00%             | -                     |
| <b>TOTAL PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA (PGA)</b> | <b>100,00%</b>    | <b>3.705.116,59</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.724.164,60</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.888.246,53</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.685.144,53</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.714.958,91</b>   | <b>100,00%</b>    | <b>3.839.063,34</b>   |