



**LDB**  
EMPRESAS

**ALEGRE**  
JULHO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.07.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 95,84%

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 |
|--|----------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|-------------------|---------|
| BANESTES                               | BANESTES | BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B             | 22,79               | 7,49            | -1,55           | 467.133,90           | 2,68         | 336.367.162,90    | 0,14    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI       | 0,54                | 0,23            | 2,69            | 3.176.503,24         | 18,20        | 7.835.713.656,67  | 0,04    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 12,47               | 4,36            | 2,54            | 2.899.531,12         | 16,61        | 5.823.784.558,48  | 0,05    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 12,54               | 4,38            | 2,42            | 2.225.868,60         | 12,75        | 6.313.416.954,01  | 0,04    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 0,53                | 0,24            | 2,73            | 1.369.988,90         | 7,85         | 10.907.406.871,77 | 0,01    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,32               | 7,29            | 1,46            | 1.985.787,44         | 11,38        | 2.059.270.796,72  | 0,10    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                | 6,08                | 1,77            | 3,55            | 2.444.224,42         | 14,00        | 10.799.663.748,52 | 0,02    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |          |   | <b>11,75</b>        | <b>3,19</b>     | <b>1,92</b>     | <b>14.569.037,62</b> | <b>83,48</b> |                   |         |

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 |
|---|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                   | 25,96               | 6,59            | -2,31           | 99.387,81            | 0,57         | 311.642.335,02   | 0,03    |
| BB                                      | BB       | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 7,67                | 1,92            | 3,80            | 2.058.207,88         | 11,79        | 1.203.931.832,99 | 0,17    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |          |  | <b>14,70</b>        | <b>2,14</b>     | <b>-1,57</b>    | <b>2.157.595,69</b>  | <b>12,36</b> |                  |         |
| <b>Renda Fixa</b>                       |          |  | <b>12,03</b>        | <b>3,06</b>     | <b>1,62</b>     | <b>16.726.633,31</b> | <b>95,84</b> |                  |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,16%

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

| Gestor                                  | Admin. | Ativo                         | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)       | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|---|--------|-------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------|------------------|---------|
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA         | 42,64               | 7,46            | 23,13           | 197.006,76        | 1,13        | 429.632.224,85   | 0,05    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES VALOR FIC FIA        | 40,86               | 6,38            | 20,25           | 358.481,23        | 2,05        | 921.115.521,73   | 0,04    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI | 43,79               | 7,83            | 6,61            | 170.582,08        | 0,98        | 1.186.372.822,45 | 0,01    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                               | <b>23,74</b>        | <b>7,01</b>     | <b>21,58</b>    | <b>726.070,07</b> | <b>4,16</b> |                  |         |
| Renda Variável                          |        |                               | 23,74               | 7,01            | 21,58           | 726.070,07        | 4,16        |                  |         |
| Total                                   |        |                               | 12,02               | 3,23            | 1,93            | 17.452.703,38     | 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 |
| <b>Renda Fixa</b>      |                              |                      |              |                           |          |        |      |              |
| Artigo 7º I, Alínea b  | Fundos 100% Títulos Públicos | 14.569.037,62        | 83,48        | 70,00                     | 80,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa         | 2.157.595,69         | 12,36        | 5,00                      | 10,00    | 30,00  | 0,00 | 40,00        |
|                        | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>16.726.633,31</b> | <b>95,84</b> |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Renda Variável</b>  |                              |                      |              |                           |          |        |      |              |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações              | 726.070,07           | 4,16         | 0,00                      | 3,00     | 6,00   | 0,00 | 20,00        |
|                        | <b>Total Renda Variável</b>  | <b>726.070,07</b>    | <b>4,16</b>  |                           |          |        |      | 30,00        |

## 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 b<br>% do CDI            | 3,19<br>1.643,46 | 1,92<br>97,86   | 5,57<br>857,51 | 1,61<br>102,13   |          | 434.258,50        | 228.095,10        |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 2,14<br>1.099,18 | -1,57<br>-79,96 | 4,51<br>694,41 | -1,86<br>-117,86 |          | 44.127,87         | -3.927,43         |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 7,01<br>-1,26    | 21,58<br>-2,37  |                |                  |          | 47.559,07         | 86.070,07         |
| <b>ALEGRE (Total)</b>                        |                  |                 |                |                  |          | <b>525.945,44</b> | <b>310.237,74</b> |

## RESULTADO POR ATIVO

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

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates   | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B             | 434.566,52     | 0,00       | 0,00       | 0,00        | 467.133,90    | 32.567,38                   | -7.369,05                   |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                | 2.401.766,73   | 0,00       | 0,00       | 0,00        | 2.444.224,42  | 42.457,69                   | 83.771,16                   |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 2.778.327,84   | 0,00       | 0,00       | 0,00        | 2.899.531,12  | 121.203,28                  | 39.702,01                   |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI       | 2.403.555,46   | 766.400,00 | 0,00       | 0,00        | 3.176.503,24  | 6.547,78                    | 46.747,09                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1.850.828,79   | 0,00       | 0,00       | 0,00        | 1.985.787,44  | 134.958,65                  | -31.951,16                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 2.132.568,46   | 0,00       | 0,00       | 0,00        | 2.225.868,60  | 93.300,14                   | 52.550,75                   |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 1.350.267,87   | 52.997,45  | -36.500,00 | 0,00        | 1.369.988,90  | 3.223,58                    | 44.644,30                   |
|   |                |            |            |             | 14.569.037,62 | 0,00                        | 0,00                        |

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

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                   | 93.243,60      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 99.387,81    | 6.144,21                    | -2.352,11                   |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 1.852.724,22   | 167.500,00 | 0,00     | 0,00        | 2.058.207,88 | 37.983,66                   | 62.687,43                   |
|  |                |            |          |             | 2.157.595,69 | 0,00                        | 0,00                        |

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                         | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo      | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA         | 183.325,99     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 197.006,76 | 13.680,77                      | 37.006,76                      |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI | 158.193,70     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 170.582,08 | 12.388,38                      | 10.582,08                      |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA        | 336.991,31     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 358.481,23 | 21.489,92                      | 38.481,23                      |
|                               |                |            |          |             | 726.070,07 | 0,00                           | 0,00                           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

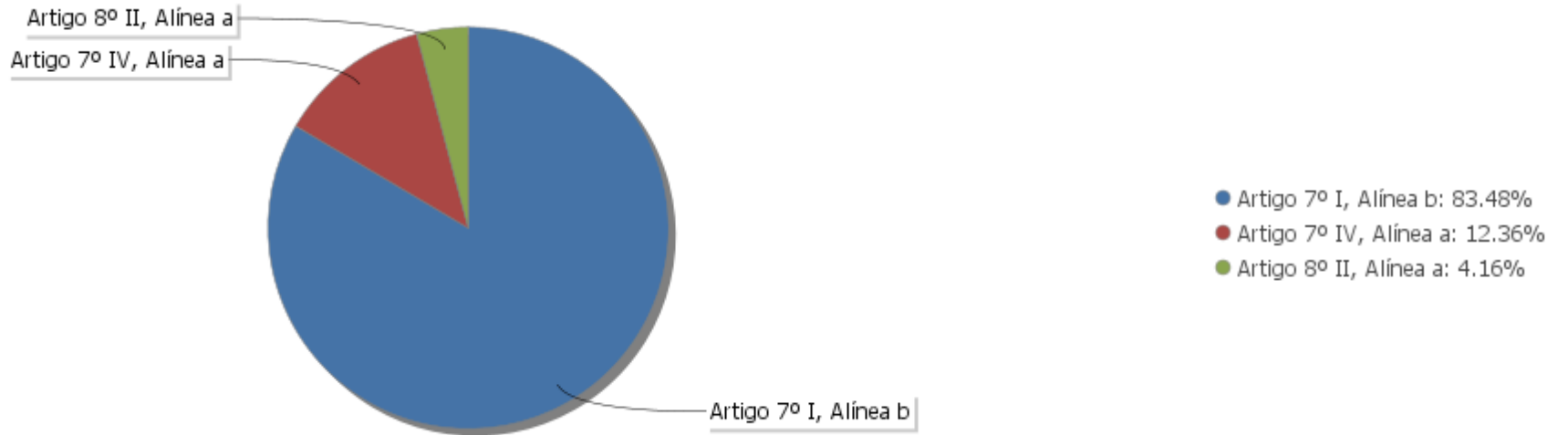
## Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)   | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 17.094.222,15 | 97,95 | 17.094.222,15         | 97,95     |
| de 31 a 365 dias  | 358.481,23    | 2,05  | 17.452.703,38         | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00          | 0,00  | 17.452.703,38         | 100,00    |

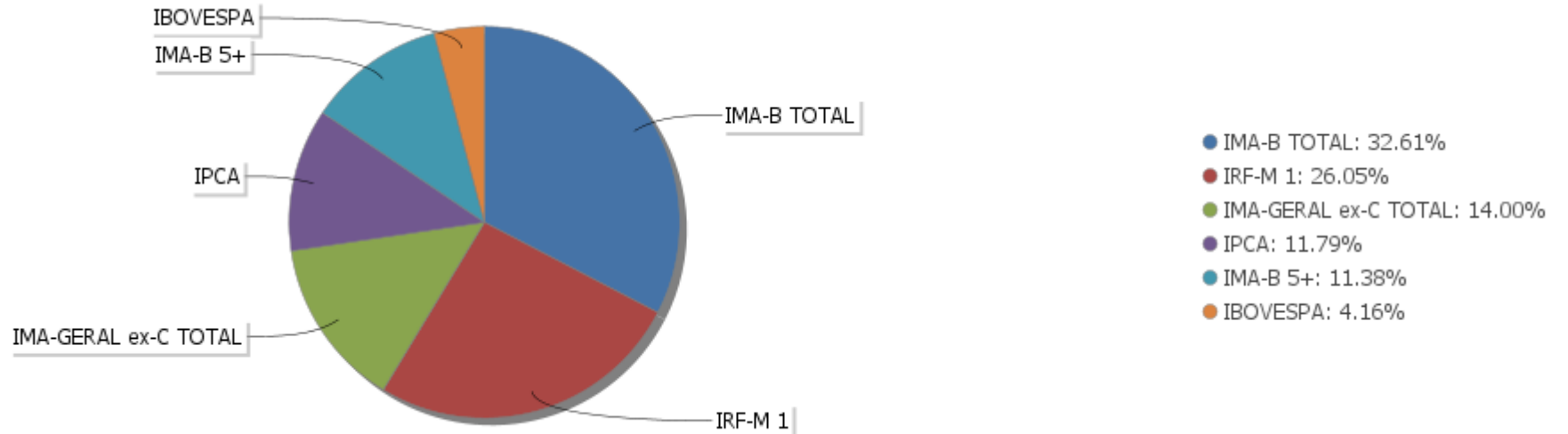


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

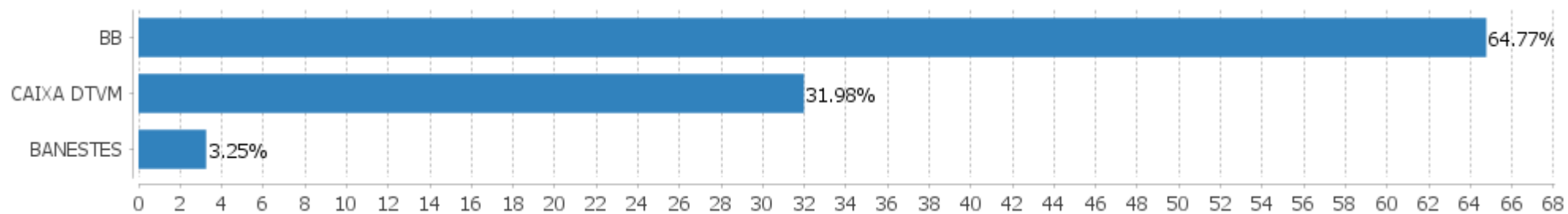


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

| Ano            | Jan   | Fev   | Mar   | Abr  | Mai  | Jun  | Jul  | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|------|------|------|------|-----|-----|-----|-----|-----|-----------|
| 2020           | 0,30  | 0,39  | -5,47 | 1,21 | 1,03 | 1,46 | 3,23 |     |     |     |     |     | 1,93      |
| IPCA + 6,00%   | 0,72  | 0,67  | 0,58  | 0,15 | 0,08 | 0,75 | 0,90 |     |     |     |     |     | 3,91      |
| p.p. indexador | -0,42 | -0,27 | -6,05 | 1,06 | 0,95 | 0,71 | 2,33 |     |     |     |     |     | -1,98     |

Performance Sobre a Meta Atuarial

|                              | Quantidade | Perc. (%) |
|------------------------------|------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 4          | 57,14     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 3          | 42,86     |

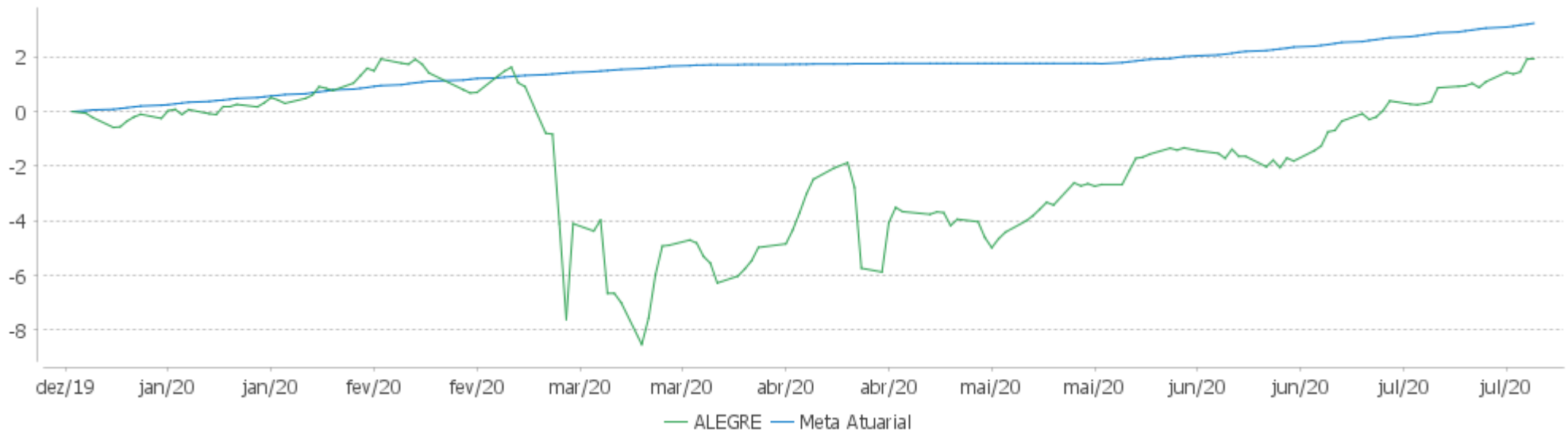
|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,23          | 2020-07 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -5,47         | 2020-03 |

Relatório

| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 5,81     | 1,73          | 4,07       | 4,20               |
| 06 meses         | 1,62     | 3,16          | -1,54      | 13,00              |
| 12 meses         |          |               |            |                    |
| 24 meses         |          |               |            |                    |
| Desde 31/12/2019 | 1,93     | 3,91          | -1,98      | 12,02              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

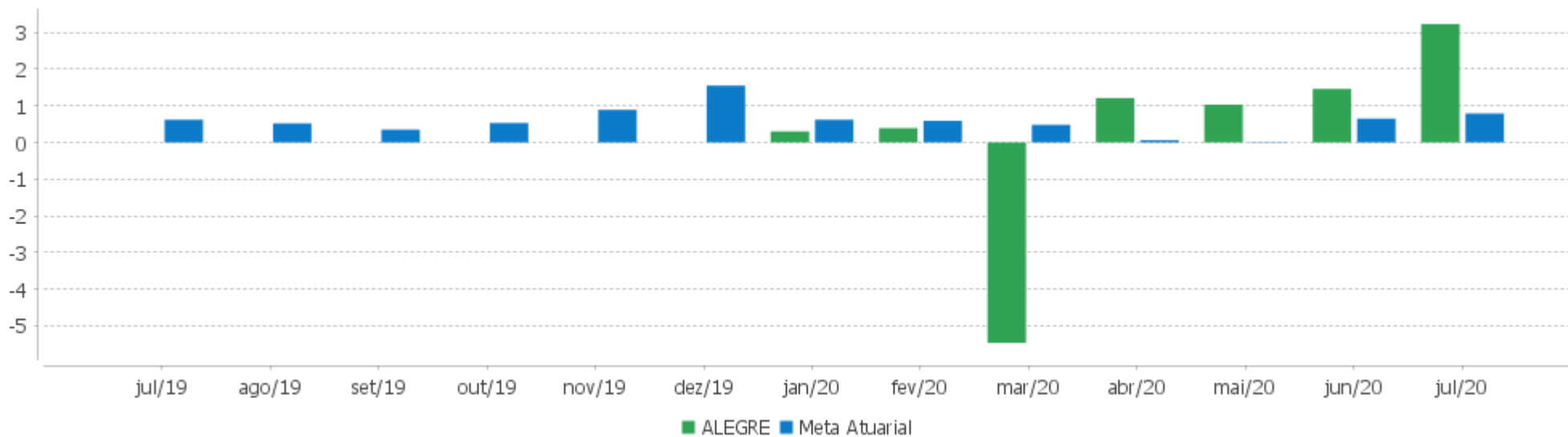


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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       |
|---|---------------|-----------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                 | 6,59<br>2,20  | -2,31<br>-4,96  | 10,55<br>2,41  | -3,03<br>-5,41  | 2,22<br>-5,94  | 38,94<br>1,08  | 44,06<br>-2,69 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI<br>Var. IPCA p.p.      | 1,92<br>1,56  | 4,90<br>4,94    | 4,09<br>3,86   |                 |                |                |                |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.          | 7,49<br>3,11  | -1,55<br>-4,20  | 10,74<br>2,60  | -2,09<br>-4,47  | 4,08<br>-4,07  | 44,21<br>6,35  | 49,90<br>3,15  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,38<br>-0,01 | 2,42<br>-0,23   | 8,09<br>-0,05  | 2,17<br>-0,22   | 7,72<br>-0,43  | 37,07<br>-0,79 | 45,56<br>-1,19 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.    | 1,77<br>0,11  | 3,55<br>0,15    | 3,83<br>0,26   | 3,05<br>0,17    | 7,10<br>0,02   | 23,78<br>0,51  | 32,81<br>0,56  |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.        | 0,23<br>-0,01 | 2,69<br>-0,15   | 0,88<br>-0,06  | 2,26<br>-0,13   | 5,22<br>-0,29  | 12,65<br>-0,54 | 20,70<br>-0,86 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.         | 4,36<br>-0,02 | 2,54<br>-0,11   | 8,07<br>-0,07  | 2,27<br>-0,11   | 7,94<br>-0,22  | 37,20<br>-0,66 | 45,69<br>-1,07 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.      | 0,24<br>0,00  | 2,73<br>-0,11   | 0,90<br>-0,04  | 2,30<br>-0,09   | 5,30<br>-0,21  | 12,79<br>-0,41 | 20,92<br>-0,64 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p. | 7,29<br>-0,03 | 1,46<br>-0,22   | 11,43<br>-0,08 | 1,50<br>-0,14   | 7,35<br>-0,46  | 47,92<br>-1,45 | 54,33<br>-1,86 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                           | 7,46<br>-0,80 | -15,22<br>-4,21 | 25,57<br>-2,26 | -14,03<br>-4,49 | -2,29<br>-3,37 | 22,77<br>-7,13 | 50,39<br>-5,73 |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI<br>Var. IBOVESPA p.p.                   | 7,83<br>-0,43 | -12,30<br>-1,29 | 22,79<br>-5,05 | -13,24<br>-3,71 | 10,01<br>8,93  |                |                |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                          | 6,38<br>-1,89 | -12,84<br>-1,83 | 22,84<br>-4,99 | -11,57<br>-2,03 | 0,02<br>-1,06  | 50,60<br>20,69 |                |
| ALEGRE<br>Var. IPCA + 4,81% p.p.                                      | 3,23<br>2,43  | 1,93<br>-1,30   | 5,81<br>4,36   | 1,62<br>-0,97   |                |                |                |
| CDI   | 0,19          | 1,96            | 0,65           | 1,58            | 4,23           | 10,85          | 18,71          |
| IBOVESPA  | 8,27          | -11,01          | 27,83          | -9,54           | 1,08           | 29,91          | 56,12          |
| INPC + 6,00%  | 0,98          | 4,26            | 1,99           | 3,54            | 8,88           | 19,01          | 30,64          |
| IPCA + 6,00%  | 0,90          | 3,91            | 1,73           | 3,16            | 8,47           | 18,63          | 31,32          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo   | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas       |               |
|---|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
|   | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                    | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B             | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA                           | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 1,00          |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI                   | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 1,00          |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA                          | D+1 du    | D+0        | D+30      | D+32       |             | 2,00          |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                | D+0       | D+0        | D+3 du    | D+3 du     |             | 0,30          |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI  | D+0       | D+0        |           | D+3 du     |             |               |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | D+0       | D+0        | D+1 du    | D+1 du     |             | 0,20          |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI       | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,10          |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |

**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         | 0,24   | 2,84   | 0,94    | 2,39    | 5,51     | 13,20    | 21,56    | 37,95    | 58,20    |
| IRF-M 1+        | 1,47   | 7,59   | 4,50    | 6,40    | 12,02    | 32,81    | 43,78    | 72,01    | 102,90   |
| IRF-M TOTAL     | 1,08   | 6,00   | 3,32    | 5,08    | 9,81     | 26,59    | 36,79    | 61,28    | 88,02    |
| IMA-B 5         | 0,99   | 4,19   | 4,28    | 3,61    | 8,83     | 24,16    | 34,43    | 52,88    | 77,77    |
| IMA-B 5+        | 7,32   | 1,68   | 11,51   | 1,64    | 7,81     | 49,37    | 56,19    | 81,01    | 123,14   |
| IMA-B TOTAL     | 4,39   | 2,65   | 8,14    | 2,38    | 8,16     | 37,86    | 46,75    | 68,72    | 103,36   |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,74   | 3,64   | 3,79    | 3,07    | 7,33     | 23,84    | 33,11    | 53,06    | 79,37    |
| IDKA 2          | 0,94   | 4,31   | 3,72    | 3,76    | 8,68     | 22,37    | 33,35    | 52,95    | 77,27    |
| IDKA 20         | 12,08  | -1,74  | 17,28   | -0,38   | 4,95     | 69,37    | 71,28    | 102,00   | 167,98   |
| CDI             | 0,19   | 1,96   | 0,65    | 1,58    | 4,23     | 10,85    | 18,71    | 33,58    | 52,29    |

**Renda Variável**

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 8,27   | -11,01 | 27,83   | -9,54   | 1,08     | 29,91    | 56,12    | 79,58    | 102,33   |
| IBRX 100                 | 8,41   | -10,43 | 28,20   | -9,30   | 2,17     | 33,69    | 59,04    | 83,45    | 104,97   |
| IBRX 50                  | 8,15   | -11,06 | 29,00   | -9,35   | 0,23     | 26,69    | 52,24    | 74,72    | 93,17    |
| SMALL CAP                | 9,50   | -13,20 | 31,66   | -13,59  | 7,86     | 55,28    | 71,97    | 116,70   | 152,93   |
| IFIX                     | -2,61  | -14,53 | 4,97    | -11,18  | 2,77     | 26,86    | 32,28    | 57,44    | 85,83    |
| Índice Consumo - ICON    | 7,62   | -4,11  | 27,54   | -7,49   | 12,15    | 54,44    | 58,02    | 66,72    | 79,11    |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,53   | -13,05 | 21,87   | -11,65  | 3,50     | 46,49    | 63,19    | 107,43   | 132,43   |



**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      | 0,36   | 0,46   | 0,24    | 0,25    | 2,31     | 5,60     | 10,34    | 13,33    | 23,23    |
| INPC      | 0,44   | 0,80   | 0,49    | 0,61    | 2,69     | 5,94     | 9,76     | 12,04    | 22,75    |
| IGPM      | 2,23   | 6,71   | 4,11    | 6,21    | 9,27     | 16,26    | 25,84    | 23,74    | 38,14    |
| SELIC     | 0,19   | 1,96   | 0,65    | 1,58    | 4,23     | 10,85    | 18,72    | 33,61    | 52,36    |

**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   | 0,26   | 30,70  | 7,69    | 23,59   | 51,69    | 60,95    | 120,08   | 141,76   | 138,37   |
| MSCI ACWI | -0,09  | 26,04  | 8,17    | 20,40   | 45,47    | 47,12    | 92,06    | 113,08   | 98,25    |

**Meta Atuarial**

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,72   | 2,77   | 1,24    | 2,20    | 6,41     | 14,20    | 24,06    | 32,50    | 49,79    |
| IPCA + 5,00% | 0,81   | 3,34   | 1,49    | 2,68    | 7,44     | 16,40    | 27,66    | 37,65    | 57,09    |
| IPCA + 5,50% | 0,85   | 3,62   | 1,61    | 2,92    | 7,96     | 17,51    | 29,48    | 40,28    | 60,85    |
| IPCA + 5,89% | 0,89   | 3,85   | 1,71    | 3,11    | 8,36     | 18,38    | 30,92    | 42,35    | 63,83    |
| IPCA + 6,00% | 0,90   | 3,91   | 1,73    | 3,16    | 8,47     | 18,63    | 31,32    | 42,94    | 64,68    |
| INPC + 4,00% | 0,80   | 3,12   | 1,50    | 2,57    | 6,82     | 14,57    | 23,41    | 31,00    | 49,21    |
| INPC + 6,00% | 0,98   | 4,26   | 1,99    | 3,54    | 8,88     | 19,01    | 30,64    | 41,32    | 64,05    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR          | Data       | Ativo  | Aplicação         | Resgate          | Quantidade       | Valor Cota   |
|--------------|------------|--|-------------------|------------------|------------------|--------------|
| 48           | 09/07/2020 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 167.500,00        | 0,00             | 161.931,52730100 | 1,0343878230 |
| 49           | 17/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 493.000,00        | 0,00             | 182.556,93895100 | 2,7005273140 |
| 50           | 17/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 0,00              | 36.500,00        | 14.113,06537327  | 2,5862560000 |
| 51           | 24/07/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 273.400,00        | 0,00             | 101.157,43471000 | 2,7027178060 |
| 52           | 27/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 52.997,45         | 0,00             | 20.469,86787030  | 2,5890470000 |
| <b>Total</b> |            |  | <b>986.897,45</b> | <b>36.500,00</b> |                  |              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 778.768,24

Value-At-Risk: 4,46%

|        | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| ALEGRE |                             | 4,46               | 4,46                |        |       | 17.452.703,38 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 3,78%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B             |                             | 18,50              | 0,04                | 19,39               |        |       | 467.133,90    | 2,68       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI       |                             | 0,34               | 0,04                | 0,02                |        |       | 3.176.503,24  | 18,20      |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            |                             | 5,98               | 0,98                | 0,10                |        |       | 2.899.531,12  | 16,61      |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    |                             | 5,93               | 0,75                | 0,04                |        |       | 2.225.868,60  | 12,75      |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     |                             | 0,34               | 0,02                | 0,01                |        |       | 1.369.988,90  | 7,85       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP |                             | 9,28               | 1,03                | 0,08                |        |       | 1.985.787,44  | 11,38      |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                |                             | 3,09               | 0,43                | 0,46                |        |       | 2.444.224,42  | 14,00      |
| <b>Sub-total</b>                                | 3,25                        | 3,99               | 3,30                |                     | 0,92   | 3,19  | 14.569.037,62 | 83,48      |

Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)   | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                   |                             | 23,47              | 0,01                | 24,24               |        |       | 99.387,81    | 0,57       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI |                             | 2,29               | 0,26                | 2,29                |        |       | 2.058.207,88 | 11,79      |
| <b>Sub-total</b>                               | 2,40                        | 2,54               | 0,27                |                     | 0,81   | 2,14  | 2.157.595,69 | 12,36      |

Renda Variável

Value-At-Risk: 25,84%

Artigo 8º II, Alínea a

| Ativo                 | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-----------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA |                             | 24,84              | 0,23                | 2,86                |        |       | 197.006,76 | 1,13       |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                         | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA        |                             | 27,64              | 0,48                | 3,82                |        |       | 358.481,23 | 2,05       |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI |                             | 27,33              | 0,18                | 16,33               |        |       | 170.582,08 | 0,98       |
| <b>Sub-total</b>              | 19,46                       | 25,84              | 0,89                |                     | 0,35   | 7,01  | 726.070,07 | 4,16       |