



**LDB**  
EMPRESAS

**ALEGRE**  
MAIO 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 29.05.2020.

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 97,83%

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	22,64	0,71	-10,47	424.837,58	2,74	260.165.233,98	0,16
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,39	2,19	3.054.687,95	19,70	7.581.218.915,05	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,41	1,50	-3,69	2.723.328,90	17,56	5.454.809.775,70	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,48	1,50	-3,82	2.090.237,08	13,48	5.962.762.833,75	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,39	2,22	1.378.716,73	8,89	10.824.772.393,85	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,11	1,00	-8,04	1.799.940,13	11,61	1.931.164.845,98	0,09
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,07	0,79	2.379.195,50	15,34	10.653.642.517,78	0,02
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>13,83</b>	<b>0,90</b>	<b>-2,59</b>	<b>13.850.943,87</b>	<b>89,31</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
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,41	0,37	-5,01	0,00	0,00	1.446.799.170,09	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,86	1,49	-10,32	91.241,65	0,59	225.670.767,85	0,04
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	10,18	0,88	0,88	1.229.732,83	7,93	131.474.647,00	0,94
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>17,51</b>	<b>1,27</b>	<b>-4,62</b>	<b>1.320.974,48</b>	<b>8,52</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>14,21</b>	<b>0,93</b>	<b>-2,71</b>	<b>15.171.918,35</b>	<b>97,83</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

2,17%

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	42,09	5,05	5,05	168.078,93	1,08	335.619.018,42	0,05
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,12	5,21	5,21	168.340,65	1,09	710.762.724,82	0,02
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>33,45</b>	<b>5,13</b>	<b>5,13</b>	<b>336.419,58</b>	<b>2,17</b>		
Renda Variável			33,45	5,13	5,13	336.419,58	2,17		
Total			14,15	1,03	-2,67	15.508.337,93	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	13.850.943,87	89,31	70,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	1.320.974,48	8,52	5,00	10,00	30,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>15.171.918,35</b>	<b>97,83</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	336.419,58	2,17	0,00	3,00	6,00	0,00	20,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>336.419,58</b>	<b>2,17</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 % do CDI	0,90 378,64	-2,59 -167,47	-3,26 -376,43			136.331,86	-397.531,25
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,27 531,71	-4,62 -299,20	-5,27 -608,50			16.450,38	-64.118,59
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,13 -0,14	5,13 -0,14				16.419,58	16.419,58
<b>ALEGRE (Total)</b>						<b>169.201,82</b>	<b>-445.230,26</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	421.838,56	0,00	0,00	0,00	424.837,58	2.999,02	-49.665,37
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2.353.957,68	0,00	0,00	0,00	2.379.195,50	25.237,82	18.742,24
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.320.716,26	0,00	-640.000,00	0,00	2.723.328,90	42.612,64	-136.500,21
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.473.944,74	1.452.000,00	-882.581,18	0,00	3.054.687,95	11.324,39	32.901,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.782.117,78	0,00	0,00	0,00	1.799.940,13	17.822,35	-217.798,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.059.334,21	0,00	0,00	0,00	2.090.237,08	30.902,87	-83.080,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.389.305,18	11.978,78	-28.000,00	0,00	1.378.716,73	5.432,77	37.869,58
					13.850.943,87	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	89.901,91	0,00	0,00	0,00	91.241,65	1.339,74	-10.498,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	1.219.090,40	0,00	0,00	1.229.732,83	10.642,43	10.642,43
BB PREV RF IMA-B	1.214.622,19	0,00	-1.219.090,40	0,00	0,00	4.468,21	-64.262,75
					1.320.974,48	0,00	0,00

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	160.000,00	0,00	0,00	168.078,93	8.078,93	8.078,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	0,00	160.000,00	0,00	0,00	168.340,65	8.340,65	8.340,65
					336.419,58	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

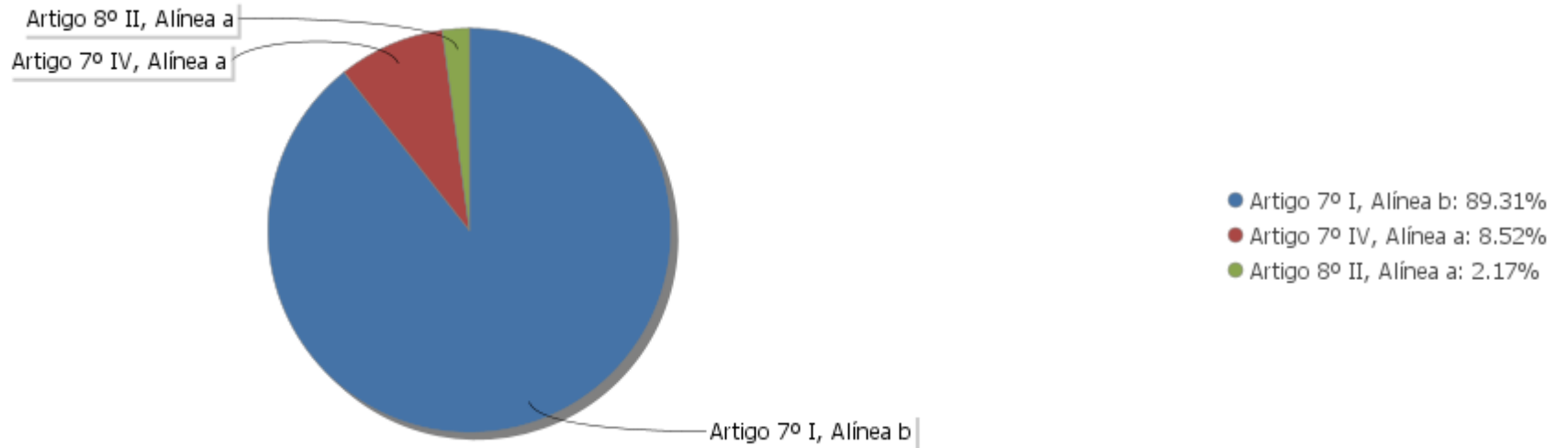
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	15.339.997,28	98,91	15.339.997,28	98,91
de 31 a 365 dias	168.340,65	1,09	15.508.337,93	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	15.508.337,93	100,00

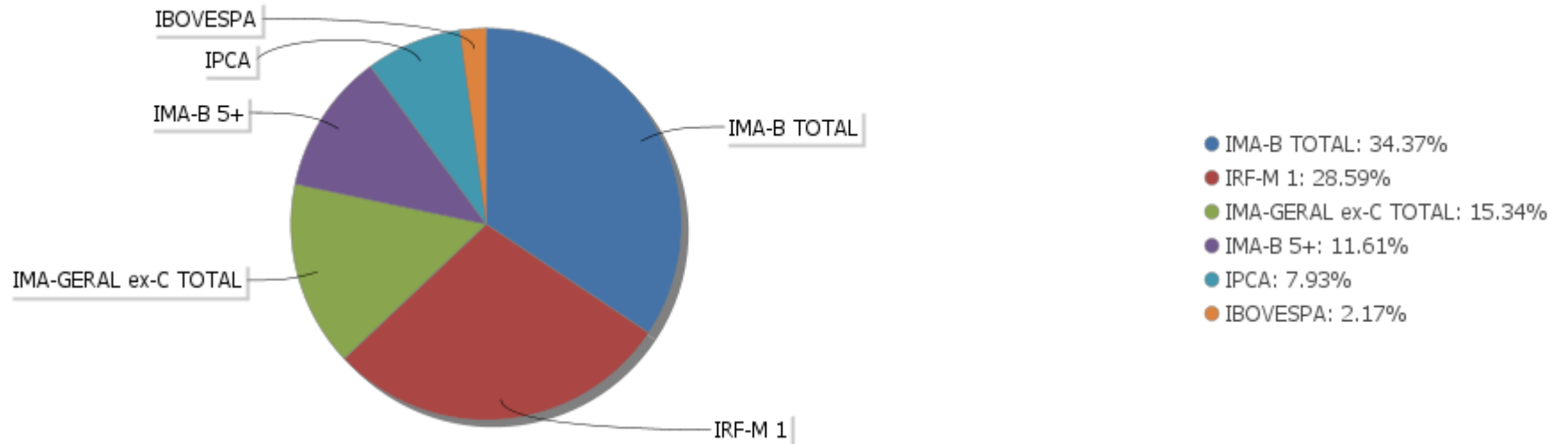


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

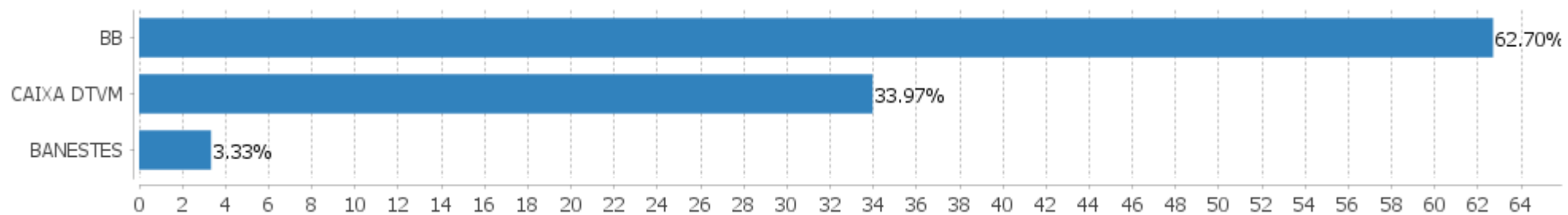


Alocação Por Estratégia



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								-2,67
IPCA + 6,00%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08								2,22
p.p. indexador	-0,42	-0,27	-6,05	1,06	0,95								-4,89

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	2	40,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	60,00

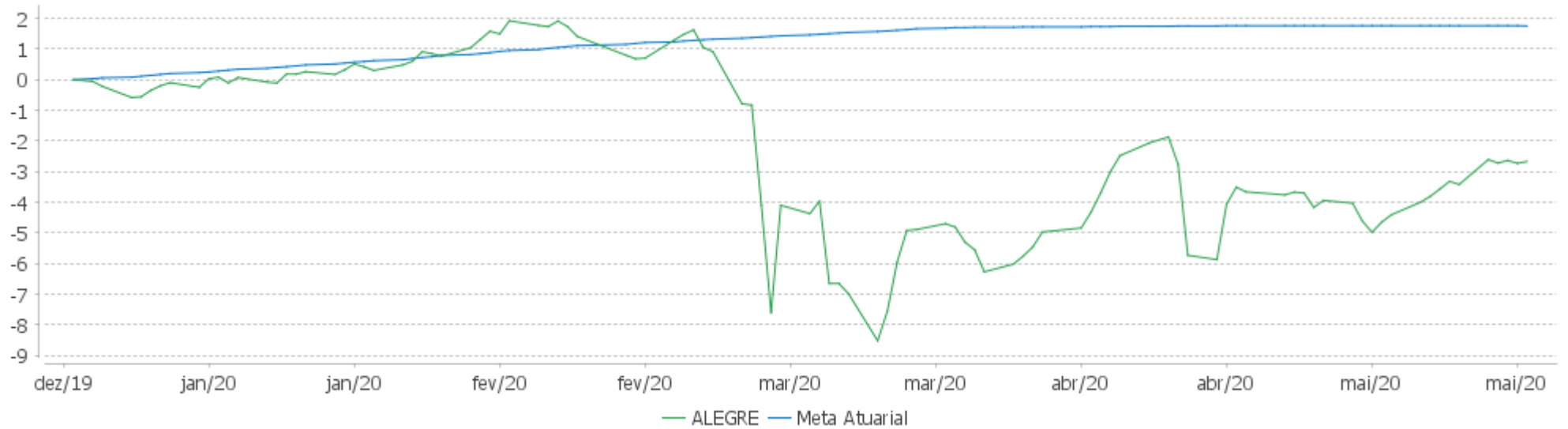
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2020-04
Menor rentabilidade da Carteira	-5,47	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-3,35	0,82	-4,16	18,00
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	-2,67	2,22	-4,89	14,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

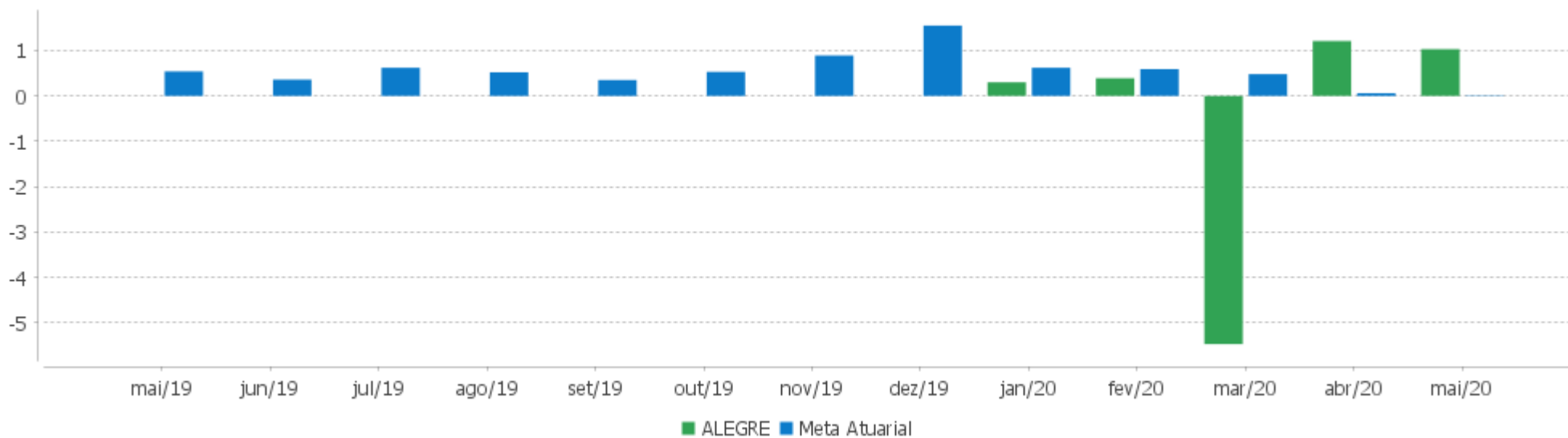


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,03	-10,32 -6,68	-11,15 -6,83	-8,19 -6,49	1,29 -5,39	29,08 -2,91	38,10 -5,41
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,54 0,03	-3,89 -0,26	-4,53 -0,21	-1,96 -0,26	6,22 -0,46	31,06 -0,93	42,41 -1,10
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,17 1,55	1,95 2,60					
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,82 -0,19	-4,48 -0,16	-1,91 -0,20	6,23 -0,45	31,21 -0,78	42,33 -1,17
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,71 -0,81	-10,47 -6,83	-11,02 -6,71	-8,17 -6,46	2,16 -4,52	33,67 1,67	42,63 -0,88
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,07 0,10	0,79 -0,00	-0,15 0,00	1,76 0,05	7,59 0,17	22,37 0,40	33,47 0,42
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,03	2,19 -0,12	1,41 -0,07	2,60 -0,14	6,04 -0,28	13,42 -0,55	22,44 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,02	2,22 -0,09	1,42 -0,05	2,63 -0,11	6,11 -0,21	13,55 -0,42	22,63 -0,66
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,69 -0,06	-4,36 -0,04	-1,79 -0,09	6,48 -0,20	31,36 -0,64	42,46 -1,05
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	1,00 -0,02	-8,04 -0,15	-8,27 -0,06	-5,68 -0,20	3,72 -0,45	36,70 -1,38	46,24 -1,80
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,13 -1,43	-27,67 -3,24	-19,86 -3,76	-21,74 -2,49	-12,93 -3,00	8,93 -4,95	32,68 -6,70
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,48 -1,08	-23,74 0,68	-15,01 1,09	-17,02 2,22	-8,97 0,96	29,31 15,44	
ALEGRE Var. IPCA + 4,81% p.p.	1,03 1,03	-2,67 -4,43	-3,35 -3,88				
CDI	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,14
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6,00%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6,00%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

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 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	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
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	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28	40,15	60,89
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28	74,77	100,23
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22	63,82	87,43
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10	52,94	78,68
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04	73,84	97,07
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51	65,49	89,01
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68	54,21	75,97
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19	52,82	78,64
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09	91,91	108,99
CDI	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,14	36,06	55,09

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37	80,32	65,66
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65	84,05	68,81
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55	74,23	58,23
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98	116,27	92,00
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22	64,83	87,49
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80	63,07	52,97
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59	116,94	88,51



**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	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67	13,61	24,20
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81	12,46	23,50
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,94	6,51	14,65	19,54	21,42	34,88
SELIC	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,15	36,11	55,16

**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	4,51	26,85	24,30	24,51	52,32	62,28	111,16	119,12	146,60
MSCI ACWI	4,14	21,34	19,85	19,72	42,55	45,06	83,76	91,01	100,15

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,07	1,44	0,34	2,94	5,94	15,29	23,27	32,81	50,97
IPCA + 5,00%	0,01	1,83	0,58	3,42	6,95	17,51	26,83	37,96	58,33
IPCA + 5,50%	0,04	2,03	0,70	3,66	7,46	18,62	28,64	40,60	62,12
IPCA + 5,89%	0,07	2,18	0,79	3,85	7,85	19,50	30,06	42,68	65,13
IPCA + 6,00%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46	43,27	65,98
INPC + 4,00%	0,06	1,66	0,67	3,24	6,12	15,62	22,31	31,46	50,12
INPC + 6,00%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45	41,81	65,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
30	13/05/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.132.000,00	0,00	421.596,64414400	2,6850308600
31	18/05/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	882.581,18	328.468,60411600	2,6869575020
32	18/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.000,00	10.882,17942071	2,5730140000
33	18/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.978,78	0,00	4.655,54404290	2,5730140000
34	20/05/2020	BB PREV RF IMA-B	0,00	1.219.090,40	234.280,81071800	5,2035435610
35	20/05/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	640.000,00	109.048,82089300	5,8689309500
36	20/05/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	320.000,00	0,00	119.071,43142900	2,6874624430
37	20/05/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.178.234,06	0,00	1.165.833,44752900	1,0106366930
38	21/05/2020	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	160.000,00	0,00	107.611,01444100	1,4868366480
39	21/05/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	160.000,00	0,00	147.191,71979400	1,0870176680
40	21/05/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	40.856,34	0,00	40.332,57166500	1,0129862370
<b>Total</b>			<b>3.003.069,18</b>	<b>2.769.671,58</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 950.914,25

Value-At-Risk: 6,13%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALEGRE		6,13	6,13			15.508.337,93	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 5,75%

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		18,10	0,05	20,44			424.837,58	2,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,32	0,05	0,01			3.054.687,95	19,70
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		9,52	1,66	0,26			2.723.328,90	17,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		9,70	1,30	0,06			2.090.237,08	13,48
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,32	0,02	0,01			1.378.716,73	8,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		14,12	1,62	0,24			1.799.940,13	11,61
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		3,93	0,60	0,37			2.379.195,50	15,34
<b>Sub-total</b>	5,02	5,94	5,29		0,13	0,90	13.850.943,87	89,31

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
BB PREV RF IMA-B		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		23,12	0,01	25,10			91.241,65	0,59
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		3,87	0,31	3,88			1.229.732,83	7,93
<b>Sub-total</b>	6,19	4,12	0,32		0,17	1,27	1.320.974,48	8,52

Renda Variável

Value-At-Risk: 29,71%

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
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

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 ALOCAÇÃO FIA		29,40	0,26	3,77			168.078,93	1,08
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		30,13	0,27	4,45			168.340,65	1,09
<b>Sub-total</b>	33,45	29,71	0,52		0,15	5,13	336.419,58	2,17