



**LDB**  
EMPRESAS

**ALEGRE**  
OUTUBRO 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 30.10.2020.

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 95,63%

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             | 23,41               | 0,92            | -9,01           | 431.745,87           | 2,34         | 273.991.442,96    | 0,16    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI       | 0,56                | 0,11            | 2,94            | 2.261.802,27         | 12,26        | 7.887.722.403,08  | 0,03    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 12,77               | 0,20            | -0,73           | 3.228.312,18         | 17,50        | 5.529.359.748,67  | 0,06    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 12,83               | 0,19            | -0,81           | 2.155.785,54         | 11,69        | 5.818.645.931,87  | 0,04    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 0,55                | 0,14            | 3,11            | 591.136,10           | 3,21         | 11.237.812.745,76 | 0,01    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,82               | 0,22            | -4,61           | 1.866.924,65         | 10,12        | 1.789.450.540,00  | 0,10    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                | 6,26                | -0,07           | 1,78            | 2.402.582,15         | 13,03        | 9.938.464.189,22  | 0,02    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |          |   | <b>10,13</b>        | <b>0,12</b>     | <b>-0,62</b>    | <b>12.938.288,76</b> | <b>70,15</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                   | 26,58               | 0,99            | -9,64           | 91.930,25            | 0,50         | 266.751.360,36   | 0,03    |
| BB                                      | BB       | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 0,23                | 0,16            | 0,29            | 2.199.461,00         | 11,93        | 2.401.972.433,04 | 0,09    |
| BB                                      | BB       | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 6,47                | -0,07           | 1,73            | 2.406.974,39         | 13,05        | 1.975.885.101,28 | 0,12    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |          |  | <b>12,36</b>        | <b>0,05</b>     | <b>-3,28</b>    | <b>4.698.365,64</b>  | <b>25,47</b> |                  |         |
| <b>Renda Fixa</b>                       |          |  | <b>10,30</b>        | <b>0,12</b>     | <b>-0,77</b>    | <b>17.636.654,40</b> | <b>95,63</b> |                  |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,37%

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 DIVIDENDOS           | 38,79               | -1,45           | -4,75           | 133.566,40        | 0,72        | 871.977.000,93   | 0,02    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA         | 43,31               | -0,86           | 12,89           | 180.618,75        | 0,98        | 388.213.527,42   | 0,05    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES VALOR FIC FIA        | 41,53               | 2,22            | 12,90           | 336.570,75        | 1,82        | 866.199.541,29   | 0,04    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI | 44,62               | -0,20           | -2,71           | 155.671,27        | 0,84        | 1.160.247.690,35 | 0,01    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                               | <b>22,90</b>        | <b>0,43</b>     | <b>12,36</b>    | <b>806.427,17</b> | <b>4,37</b> |                  |         |
| Renda Variável                          |        |                               | 22,90               | 0,43            | 12,36           | 806.427,17        | 4,37        |                  |         |
| Total                                   |        |                               | 10,36               | 0,14            | -0,70           | 18.443.081,57     | 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 | 12.938.288,76        | 70,15        | 70,00                     | 80,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa         | 4.698.365,64         | 25,47        | 5,00                      | 10,00    | 30,00  | 0,00 | 40,00        |
|                        | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>17.636.654,40</b> | <b>95,63</b> |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Renda Variável</b>  |                              |                      |              |                           |          |        |      |              |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações              | 806.427,17           | 4,37         | 0,00                      | 3,00     | 6,00   | 0,00 | 20,00        |
|                        | <b>Total Renda Variável</b>  | <b>806.427,17</b>    | <b>4,37</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            | 0,12<br>79,36 | -0,62<br>-25,15  | -2,49<br>-522,85 | 2,95<br>261,09 |          | 20.462,79        | -133.420,53        |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 0,05<br>34,95 | -3,28<br>-134,05 | -1,74<br>-365,44 | 2,70<br>238,86 |          | 901,56           | -50.813,71         |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 0,43<br>1,12  | 12,36<br>-0,80   | -7,59<br>1,12    |                |          | 3.460,69         | 24.323,53          |
| <b>ALEGRE (Total)</b>                        |               |                  |                  |                |          | <b>24.825,04</b> | <b>-159.910,71</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             | 427.825,55     | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 431.745,87    | 3.920,32                    | -42.757,08                  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                | 2.404.270,84   | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 2.402.582,15  | -1.688,69                   | 42.128,89                   |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            | 3.222.003,29   | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 3.228.312,18  | 6.308,89                    | -66.316,93                  |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI       | 3.140.876,34   | 0,00       | -882.014,10 | 0,00        | 2.261.802,27  | 2.940,03                    | 54.331,18                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1.862.866,62   | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 1.866.924,65  | 4.058,03                    | -150.813,95                 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 2.151.621,61   | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 2.155.785,54  | 4.163,93                    | -17.532,31                  |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 525.875,72     | 91.100,10  | -26.600,00  | 0,00        | 591.136,10    | 760,28                      | 47.539,67                   |
|   |                |            |             |             | 12.938.288,76 | 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                   | 91.026,79      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 91.930,25    | 903,46                      | -9.809,67                   |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 2.076.133,59   | 333.600,00 | 0,00     | 0,00        | 2.406.974,39 | -2.759,20                   | 19.853,94                   |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 1.501.403,70   | 695.300,00 | 0,00     | 0,00        | 2.199.461,00 | 2.757,30                    | 3.404,77                    |
|  |                |            |          |             | 4.698.365,64 | 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         | 182.194,41     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 180.618,75 | -1.575,66                      | 20.618,75                      |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS           | 135.537,01     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 133.566,40 | -1.970,61                      | -8.537,24                      |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI | 155.987,01     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 155.671,27 | -315,74                        | -4.328,73                      |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA        | 329.248,05     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 336.570,75 | 7.322,70                       | 16.570,75                      |
|                               |                |            |          |             | 806.427,17 | 0,00                           | 0,00                           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

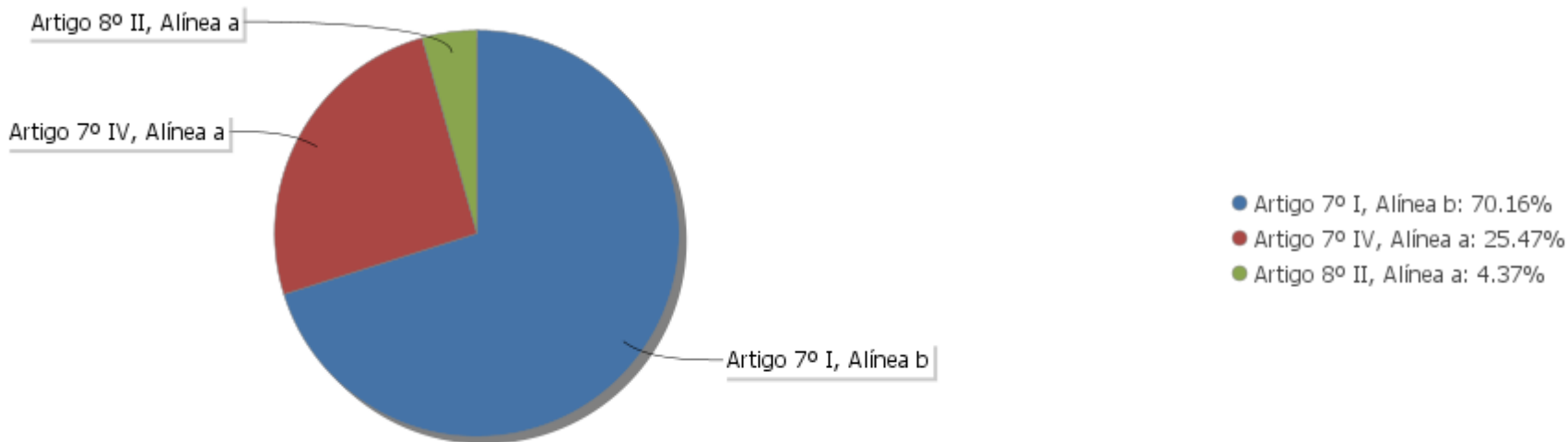
## Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)   | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 18.106.510,82 | 98,18 | 18.106.510,82         | 98,18     |
| de 31 a 365 dias  | 336.570,75    | 1,82  | 18.443.081,57         | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00          | 0,00  | 18.443.081,57         | 100,00    |

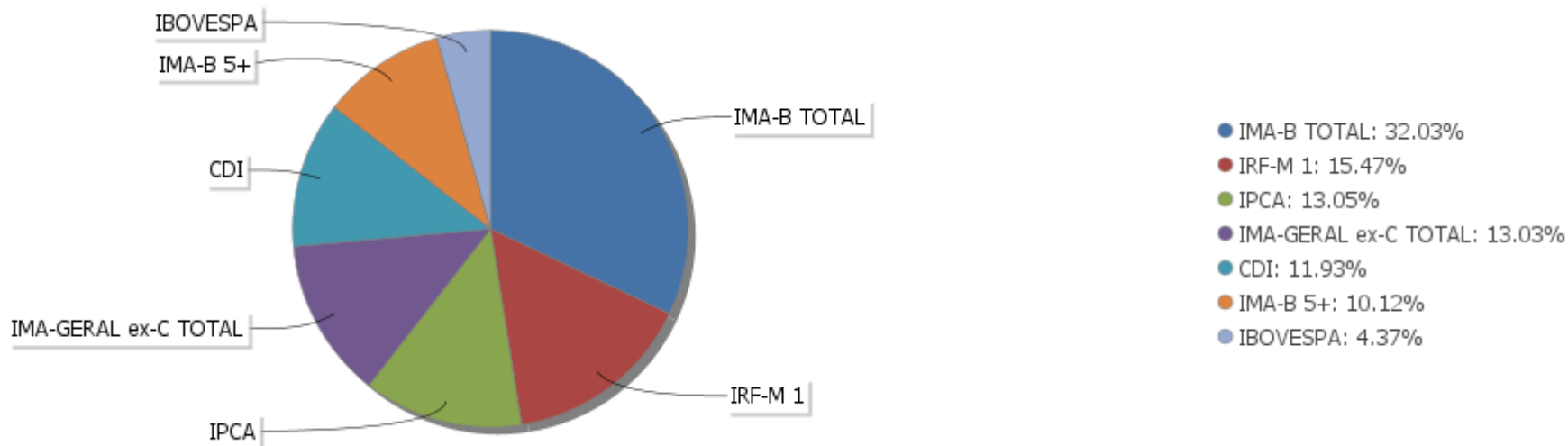


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

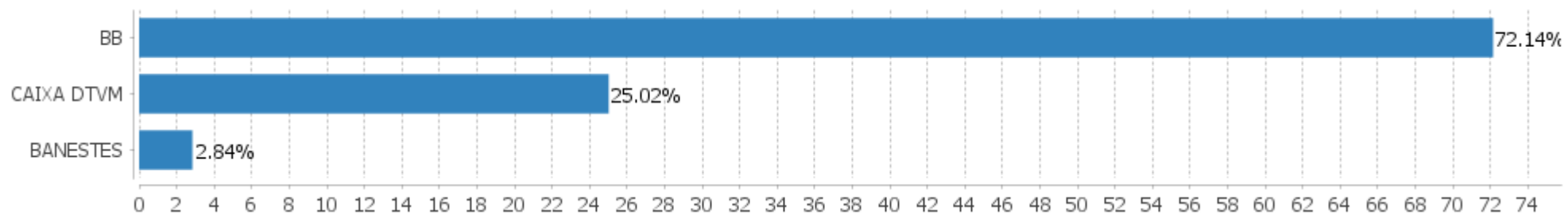


Alocação Por Estratégia



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 | -1,43 | -1,31 | 0,14  |     |     | -0,70     |
| IPCA + 6,00%   | 0,72  | 0,67  | 0,58  | 0,15 | 0,08 | 0,75 | 0,90 | 0,73  | 1,13  | 1,35  |     |     | 7,28      |
| p.p. indexador | -0,42 | -0,27 | -6,05 | 1,06 | 0,95 | 0,71 | 2,33 | -2,15 | -2,44 | -1,21 |     |     | -7,98     |

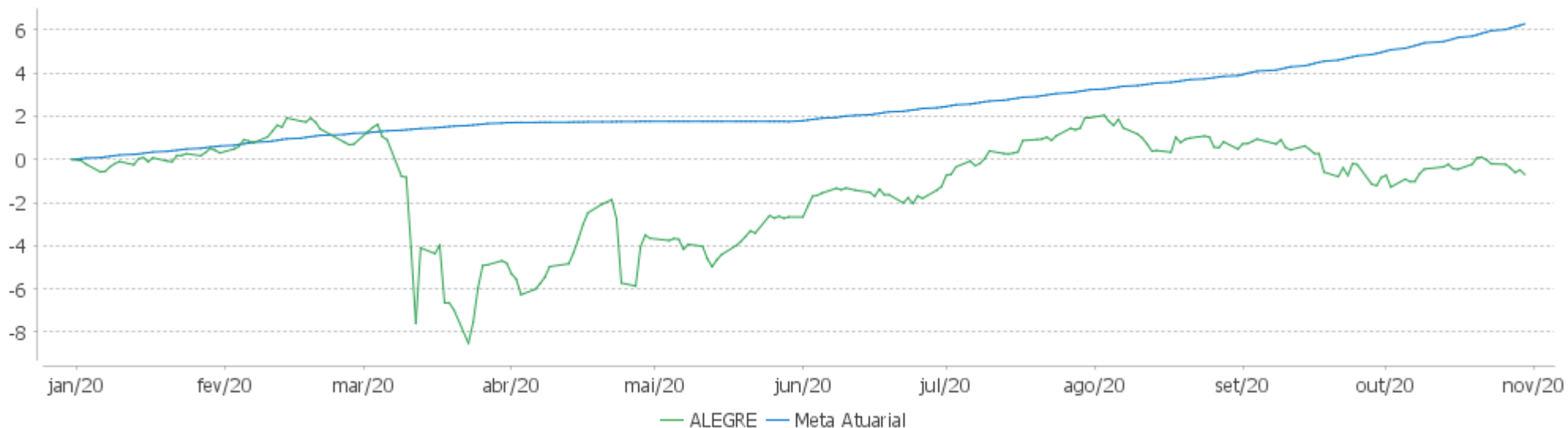
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 4          | 40,00     | 03 meses         | -2,58    | 3,24          | -5,82      | 4,67               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 6          | 60,00     | 06 meses         | 3,08     | 5,03          | -1,96      | 4,54               |
|                                 |            |           | 12 meses         |          |               |            |                    |
|                                 |            |           | 24 meses         |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,23       | 2020-07   | Desde 31/12/2019 | -0,70    | 7,28          | -7,98      | 10,36              |
| Menor rentabilidade da Carteira | -5,47      | 2020-03   |                  |          |               |            |                    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

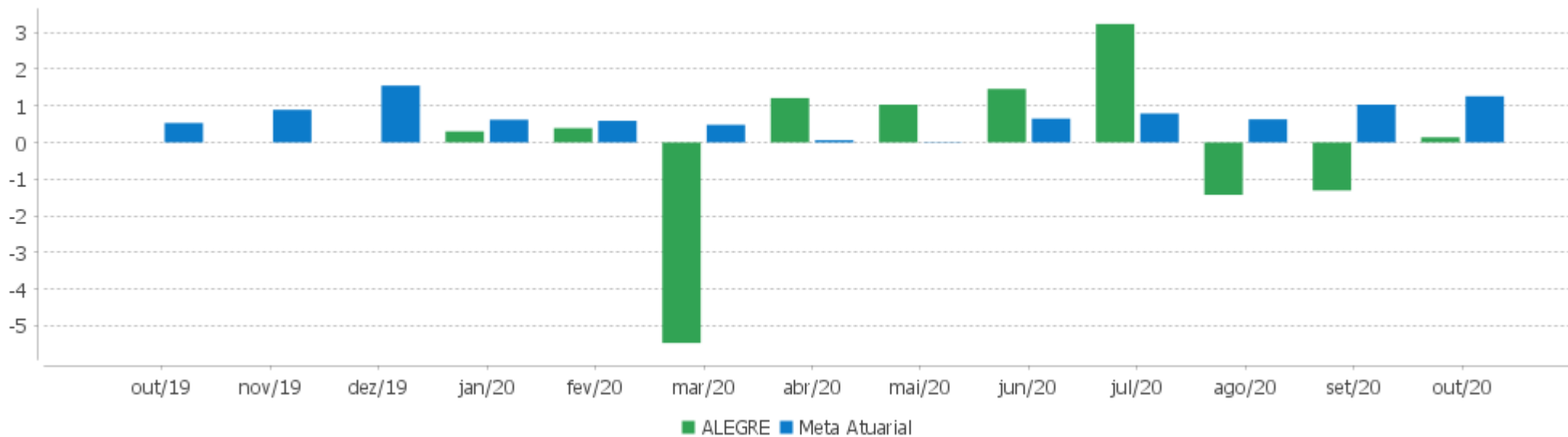


Patrimônio Líquido



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.                 | 0,99<br>0,78   | -9,64<br>-9,13  | -7,50<br>-4,43 | 2,26<br>-2,56  | -11,64<br>-10,63 | 20,12<br>-5,35 | 29,19<br>-9,20  |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                        | 0,16<br>101,53 | 1,98<br>81,01   | 0,36<br>76,75  | 1,12<br>99,39  | 2,69<br>83,53    | 8,87<br>92,08  | 15,98<br>95,06  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI<br>Var. IPCA p.p.      | -0,07<br>-0,93 | 2,82<br>1,10    | -1,99<br>-3,74 | 2,03<br>0,03   |                  |                |                 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.          | 0,92<br>0,70   | -9,01<br>-8,50  | -7,58<br>-4,50 | 2,35<br>-2,47  | -10,73<br>-9,72  | 23,19<br>-2,27 | 34,63<br>-3,75  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,19<br>-0,02  | -0,81<br>-0,30  | -3,15<br>-0,07 | 4,68<br>-0,13  | -1,41<br>-0,40   | 24,69<br>-0,78 | 37,24<br>-1,15  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.    | -0,07<br>-0,07 | 1,78<br>-0,17   | -1,70<br>-0,31 | 2,07<br>-0,07  | 1,80<br>-0,37    | 17,32<br>0,22  | 27,46<br>0,26   |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.        | 0,11<br>-0,05  | 2,94<br>-0,34   | 0,24<br>-0,19  | 1,13<br>-0,25  | 3,67<br>-0,39    | 10,79<br>-0,70 | 18,38<br>-0,98  |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.      | 0,14<br>-0,02  | 3,11<br>-0,17   | 0,37<br>-0,06  | 1,27<br>-0,10  | 3,85<br>-0,21    | 11,05<br>-0,44 | 18,71<br>-0,65  |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.         | 0,20<br>-0,02  | -0,73<br>-0,23  | -3,19<br>-0,11 | 4,62<br>-0,19  | -1,29<br>-0,28   | 24,83<br>-0,64 | 37,31<br>-1,07  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p. | 0,22<br>-0,00  | -4,61<br>-0,27  | -5,99<br>-0,06 | 4,76<br>-0,14  | -6,25<br>-0,40   | 27,85<br>-1,13 | 41,32<br>-1,69  |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                           | -0,86<br>-0,18 | -22,27<br>-3,51 | -8,32<br>0,39  | 15,13<br>-1,58 | -15,20<br>-2,83  | 2,38<br>-5,08  | 20,30<br>-6,13  |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS<br>Var. IBOVESPA p.p.                             | -1,45<br>-0,77 | -24,73<br>-5,97 | -9,28<br>-0,58 | 8,19<br>-8,51  | -18,47<br>-6,10  | 2,43<br>-5,04  | 13,58<br>-12,86 |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI<br>Var. IBOVESPA p.p.                   | -0,20<br>0,49  | -19,97<br>-1,21 | -8,74<br>-0,03 | 12,05<br>-4,65 | -8,82<br>3,55    |                |                 |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                          | 2,22<br>2,91   | -18,17<br>0,59  | -6,11<br>2,59  | 15,33<br>-1,37 | -8,40<br>3,98    | 20,65<br>13,18 |                 |
| ALEGRE<br>Var. IPCA + 4,81% p.p.                                      | 0,14<br>-1,12  | -0,70<br>-6,98  | -2,58<br>-5,53 | 3,08<br>-1,36  |                  |                |                 |
| CDI   | 0,16           | 2,45            | 0,48           | 1,13           | 3,22             | 9,63           | 16,82           |
| IBOVESPA  | -0,69          | -18,76          | -8,71          | 16,70          | -12,37           | 7,47           | 26,44           |
| INPC + 6,00%  | 1,38           | 8,05            | 3,63           | 5,69           | 11,01            | 20,67          | 32,97           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IPCA + 6,00%                    | 1,35   | 7,28   | 3,24    | 5,03    | 10,10    | 19,67    | 32,57    |

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 DIVIDENDOS                             | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+3 du     |             | 2,00          |
| 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          |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI              | D+0       | D+0        | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| 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         | 0,16   | 3,29   | 0,43    | 1,38    | 4,06     | 11,49    | 19,36    | 34,03    | 53,77    |
| IRF-M 1+        | -0,61  | 4,76   | -2,63   | 1,75    | 4,63     | 23,41    | 36,20    | 60,11    | 105,24   |
| IRF-M TOTAL     | -0,33  | 4,27   | -1,63   | 1,64    | 4,44     | 19,78    | 31,08    | 52,25    | 86,59    |
| IMA-B 5         | 0,20   | 4,72   | 0,50    | 4,81    | 5,71     | 20,28    | 31,47    | 49,19    | 73,77    |
| IMA-B 5+        | 0,22   | -4,35  | -5,92   | 4,90    | -5,85    | 28,98    | 43,02    | 64,85    | 117,93   |
| IMA-B TOTAL     | 0,21   | -0,51  | -3,08   | 4,81    | -1,00    | 25,47    | 38,38    | 58,57    | 99,70    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,09   | 2,49   | -1,11   | 2,64    | 2,67     | 17,87    | 28,36    | 46,25    | 77,29    |
| IDKA 2          | 0,04   | 5,45   | 1,09    | 4,85    | 6,73     | 19,60    | 31,26    | 49,77    | 72,95    |
| IDKA 20         | 0,68   | -11,22 | -9,64   | 5,97    | -13,27   | 34,55    | 50,97    | 76,13    | 165,54   |
| CDI             | 0,16   | 2,45   | 0,48    | 1,13    | 3,22     | 9,63     | 16,82    | 29,79    | 48,04    |

**Renda Variável**

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -0,69  | -18,76 | -8,71   | 16,70   | -12,37   | 7,47     | 26,44    | 44,71    | 104,83   |
| IBRX 100                 | -0,55  | -17,87 | -8,31   | 17,55   | -11,05   | 11,01    | 29,92    | 49,30    | 108,58   |
| IBRX 50                  | -0,54  | -18,50 | -8,37   | 18,20   | -12,42   | 5,25     | 23,91    | 41,56    | 96,73    |
| SMALL CAP                | -2,28  | -20,78 | -8,74   | 20,16   | -6,17    | 34,08    | 41,52    | 84,32    | 147,59   |
| IFIX                     | -1,01  | -13,47 | 1,23    | 6,27    | -0,90    | 23,38    | 24,28    | 46,71    | 93,46    |
| Índice Consumo - ICON    | -2,86  | -11,86 | -8,08   | 17,23   | -1,94    | 42,20    | 27,52    | 48,74    | 77,51    |
| Índice Dividendos - IDIV | 0,65   | -20,56 | -8,64   | 11,34   | -10,58   | 24,50    | 30,96    | 62,38    | 139,11   |

**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      | 0,86   | 2,22   | 1,75    | 1,99    | 3,92     | 6,55     | 11,41    | 14,42    | 23,43    |
| INPC      | 0,89   | 2,95   | 2,13    | 2,63    | 4,77     | 7,45     | 11,75    | 13,80    | 23,48    |
| IGPM      | 3,23   | 18,10  | 10,67   | 15,22   | 20,93    | 24,74    | 38,21    | 36,26    | 48,22    |
| SELIC     | 0,16   | 2,45   | 0,48    | 1,13    | 3,22     | 9,63     | 16,83    | 29,82    | 48,10    |

**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   | -0,51  | 44,93  | 10,89   | 19,41   | 55,18    | 87,21    | 123,65   | 179,05   | 135,21   |
| MSCI ACWI | -0,24  | 39,59  | 10,75   | 19,80   | 48,62    | 76,53    | 95,42    | 143,23   | 100,40   |

**Meta Atuarial**

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,19   | 5,59   | 2,75    | 4,03    | 8,04     | 15,21    | 25,24    | 33,75    | 50,03    |
| IPCA + 5,00% | 1,27   | 6,44   | 3,00    | 4,53    | 9,07     | 17,43    | 28,87    | 38,94    | 57,34    |
| IPCA + 5,50% | 1,31   | 6,86   | 3,12    | 4,78    | 9,59     | 18,55    | 30,71    | 41,59    | 61,11    |
| IPCA + 5,89% | 1,34   | 7,18   | 3,22    | 4,98    | 9,99     | 19,42    | 32,16    | 43,69    | 64,09    |
| IPCA + 6,00% | 1,35   | 7,28   | 3,24    | 5,03    | 10,10    | 19,67    | 32,57    | 44,28    | 64,94    |
| INPC + 4,00% | 1,22   | 6,36   | 3,14    | 4,68    | 8,93     | 16,18    | 25,62    | 33,02    | 50,09    |
| INPC + 6,00% | 1,38   | 8,05   | 3,63    | 5,69    | 11,01    | 20,67    | 32,97    | 43,50    | 65,01    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR          | Data       | Ativo  | Aplicação           | Resgate           | Quantidade       | Valor Cota   |
|--------------|------------|--|---------------------|-------------------|------------------|--------------|
| 78           | 14/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 245.300,00          | 0,00              | 107.073,12066700 | 2,2909577910 |
| 79           | 16/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 350.000,00          | 0,00              | 152.773,43359200 | 2,2909742340 |
| 77           | 19/10/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI      | 0,00                | 882.014,10        | 325.543,24180300 | 2,7093608060 |
| 82           | 19/10/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 0,00                | 26.600,00         | 10.238,53082471  | 2,5980290000 |
| 81           | 22/10/2020 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 333.600,00          | 0,00              | 323.234,75702500 | 1,0320672290 |
| 83           | 27/10/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 91.100,10           | 0,00              | 35.049,72939407  | 2,5991670000 |
| 80           | 30/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 100.000,00          | 0,00              | 43.622,98159000  | 2,2923696720 |
| <b>Total</b> |            |  | <b>1.120.000,10</b> | <b>908.614,10</b> |                  |              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 375.979,83

Value-At-Risk: 2,04%

|        | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| ALEGRE |                             | 2,04               | 2,04                |        |       | 18.443.081,57 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,88%

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             |                             | 5,38               | -0,01               | 6,54                |        |       | 431.745,87    | 2,34       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI       |                             | 0,17               | 0,01                | 0,05                |        |       | 2.261.802,27  | 12,26      |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI            |                             | 3,15               | 0,54                | 0,04                |        |       | 3.228.312,18  | 17,50      |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    |                             | 3,16               | 0,36                | 0,02                |        |       | 2.155.785,54  | 11,69      |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     |                             | 0,16               | 0,00                | 0,02                |        |       | 591.136,10    | 3,21       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP |                             | 4,93               | 0,49                | 0,04                |        |       | 1.866.924,65  | 10,12      |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                |                             | 1,34               | 0,17                | 0,22                |        |       | 2.402.582,15  | 13,03      |
| <b>Sub-total</b>                                | 3,44                        | 2,27               | 1,57                |                     | -0,01  | 0,12  | 12.938.288,76 | 70,15      |

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                   |                             | 4,92               | -0,00               | 6,19                |        |       | 91.930,25    | 0,50       |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             |                             | 0,10               | 0,00                | 0,10                |        |       | 2.199.461,00 | 11,93      |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI |                             | 1,56               | 0,20                | 1,56                |        |       | 2.406.974,39 | 13,05      |
| <b>Sub-total</b>                               | 1,79                        | 0,81               | 0,20                |                     | -0,06  | 0,05  | 4.698.365,64 | 25,47      |

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,12%

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 DIVIDENDOS           |                             | 9,39               | 0,05                | 2,88                |        |       | 133.566,40 | 0,72       |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA         |                             | 10,05              | 0,07                | 1,47                |        |       | 180.618,75 | 0,98       |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA        |                             | 10,33              | 0,12                | 2,13                |        |       | 336.570,75 | 1,82       |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI |                             | 10,76              | 0,03                | 11,15               |        |       | 155.671,27 | 0,84       |
| <b>Sub-total</b>              | 24,40                       | 9,12               | 0,27                |                     | 0,01   | 0,43  | 806.427,17 | 4,37       |