



LDB
EMPRESAS

ALEGRE
SETEMBRO 2021



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 30.09.2021.

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

95,09%

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	8,53	-0,87	-7,23	427.222,84	2,01	274.793.726,45	0,16
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,37	1,53	1.078.975,79	5,08	6.892.529.188,23	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	3.366.798,47	15,85	7.233.196.021,39	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	-0,16	-2,51	2.247.317,90	10,58	5.161.580.539,44	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	1,59	418.439,61	1,97	6.805.654.314,46	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-1,27	-6,87	1.918.150,26	9,03	1.307.235.728,08	0,15
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-1,38	2.446.390,40	11,52	8.672.013.980,14	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,26	-0,26	-2,27	11.903.295,27	56,04		

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	8,88	-0,60	-6,88	92.060,19	0,43	239.082.190,86	0,04
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,46	2,64	3.298.658,32	15,53	5.468.058.659,45	0,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,92	0,11	-0,85	4.904.584,60	23,09	4.429.459.913,60	0,11
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,87	0,23	0,36	8.295.303,11	39,05		
Renda Fixa			3,42	-0,07	-1,39	20.198.598,38	95,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,91%

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	18,73	-6,04	-10,92	225.874,53	1,06	745.348.218,75	0,03
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,70	-7,05	-8,20	209.463,29	0,99	461.684.635,98	0,05
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,56	-2,52	-2,28	425.983,94	2,01	1.139.604.291,88	0,04
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	20,28	-7,71	-3,23	181.714,80	0,86	1.709.110.671,86	0,01
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,46	-5,15	-5,62	1.043.036,56	4,91		
Renda Variável			19,46	-5,15	-5,62	1.043.036,56	4,91		
Total			3,79	-0,33	-1,59	21.241.634,94	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	140.201,38
Sub-total Disponibilidades Financeiras	140.201,38
Total	21.381.836,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	11.903.295,27	56,04	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	8.295.303,11	39,05	0,00	40,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	20.198.598,38	95,09					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	1.043.036,56	4,91	0,00	15,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável	1.043.036,56	4,91					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	-0,26 -60,36	-2,27 -90,38	-1,50 -122,48	0,30 14,87	3,15 105,26	-31.688,36	-320.434,56
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,23 52,63	0,36 14,45	0,08 6,57	1,29 64,24	2,63 87,80	20.621,86	41.188,28
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,15 1,42	-5,62 1,14	-11,28 1,19	-3,74 1,10	19,30 1,99	-56.561,40	-61.394,59
ALEGRE (Total)						-67.627,90	-340.640,87

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	430.987,69	0,00	0,00	0,00	427.222,84	-3.764,85	-33.801,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2.446.520,36	0,00	0,00	0,00	2.446.390,40	-129,96	-34.207,30
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.371.976,27	0,00	0,00	0,00	3.366.798,47	-5.177,80	-85.085,97
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.075.037,74	0,00	0,00	0,00	1.078.975,79	3.938,05	19.163,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.942.729,15	0,00	0,00	0,00	1.918.150,26	-24.578,89	-141.485,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.250.824,15	0,00	0,00	0,00	2.247.317,90	-3.506,25	-57.759,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	420.341,54	37.066,73	-40.500,00	0,00	418.439,61	1.531,34	12.740,74
					11.903.295,27	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	92.616,84	0,00	0,00	0,00	92.060,19	-556,65	-6.931,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	4.899.331,81	0,00	0,00	0,00	4.904.584,60	5.252,79	-20.204,82
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.272.536,60	595.000,00	-584.804,00	0,00	3.298.658,32	15.925,72	68.324,89
					8.295.303,11	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	225.355,46	0,00	0,00	0,00	209.463,29	-15.892,17	-18.715,82
BB AÇÕES DIVIDENDOS	238.884,14	1.452,00	0,00	0,00	225.874,53	-14.461,61	-26.700,74
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	196.902,85	0,00	0,00	0,00	181.714,80	-15.188,05	-6.056,83
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	437.003,51	0,00	0,00	0,00	425.983,94	-11.019,57	-9.921,20
					1.043.036,56	0,00	0,00

Disponibilidades Financeiras

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00	140.201,38	0,00	0,00	140.201,38	0,00	0,00
					140.201,38	0,00	0,00

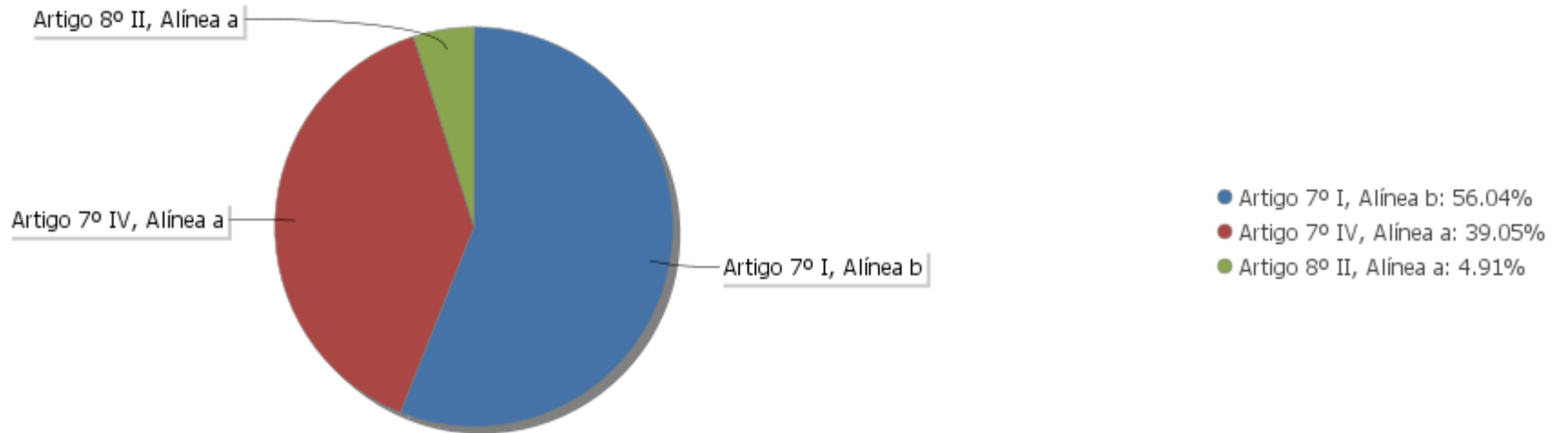
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

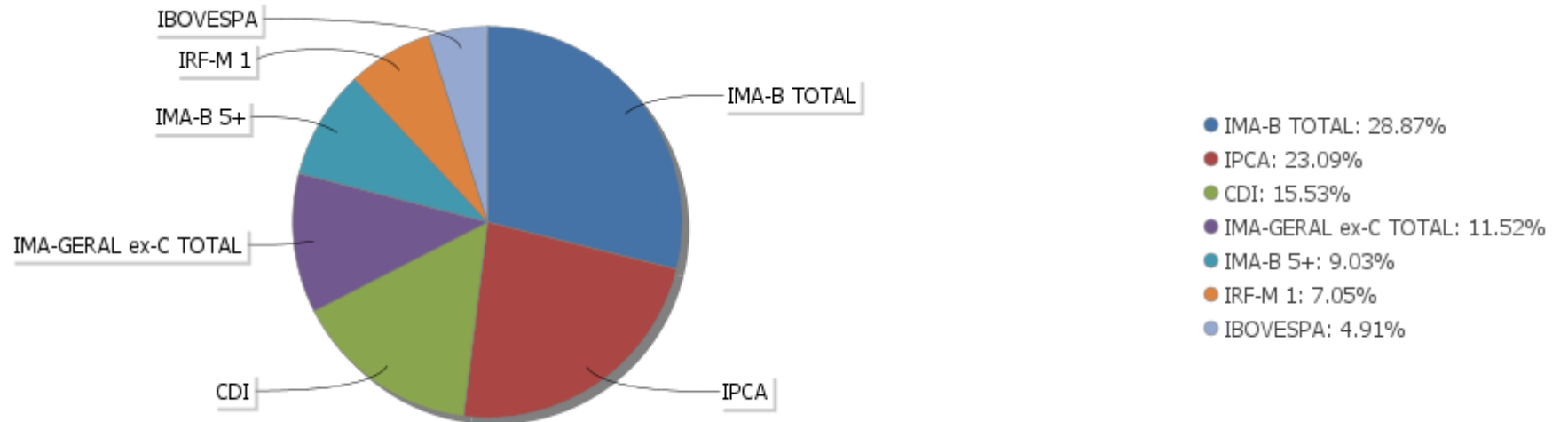
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	20.815.651,00	97,99	20.815.651,00	97,99
de 31 a 365 dias	425.983,94	2,01	21.241.634,94	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	21.241.634,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

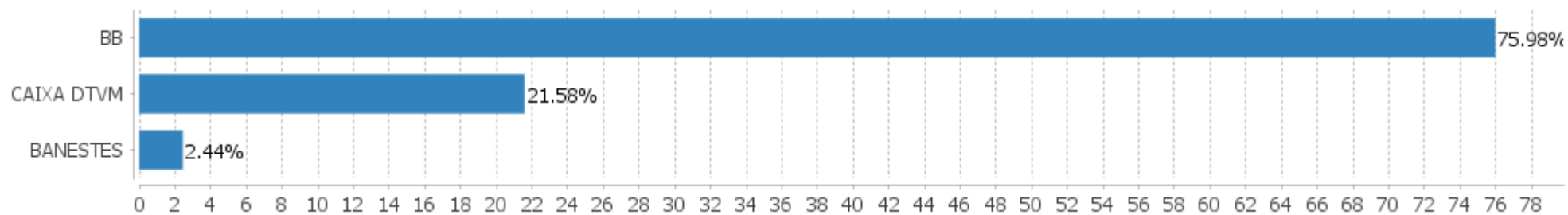


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,78	-1,20	-0,06	0,70	0,96	0,28	-0,41	-0,74	-0,33				-1,59
IPCA + 5,39%	0,67	1,24	1,41	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60				11,17
p.p. indexador	-1,45	-2,44	-1,47	-0,03	-0,32	-0,69	-1,84	-2,07	-1,94				-12,76
2020	0,30	0,39	-5,47	1,21	1,03	1,46	3,23	-1,43	-1,31	0,14	1,84	3,54	4,70
IPCA + 6,00%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	1,36	1,87	10,76
p.p. indexador	-0,42	-0,27	-6,05	1,06	0,95	0,71	2,33	-2,15	-2,44	-1,21	0,48	1,67	-6,06

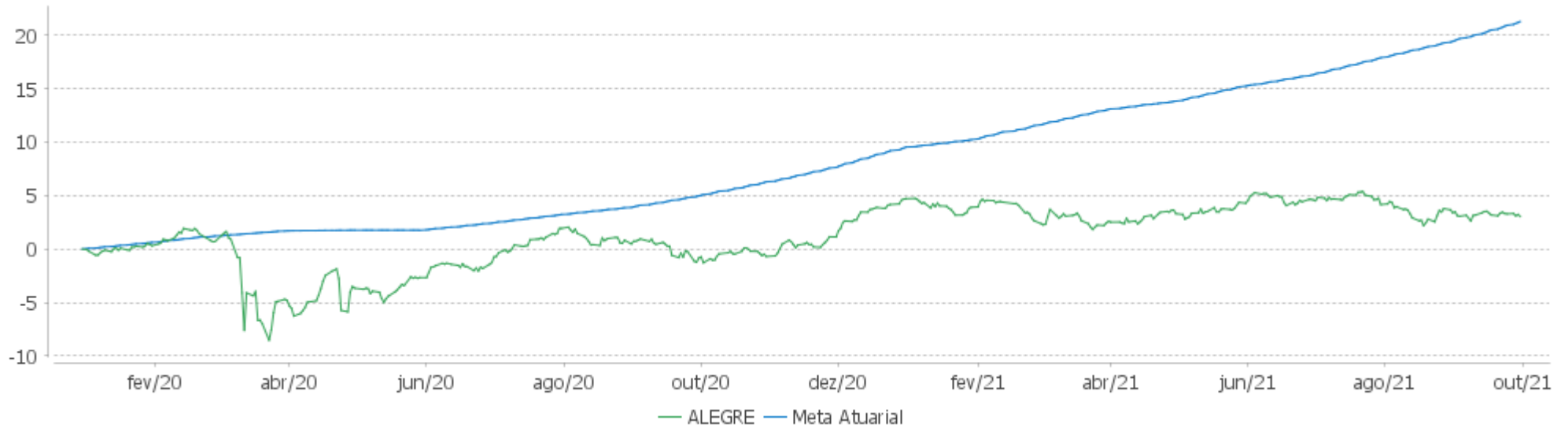
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

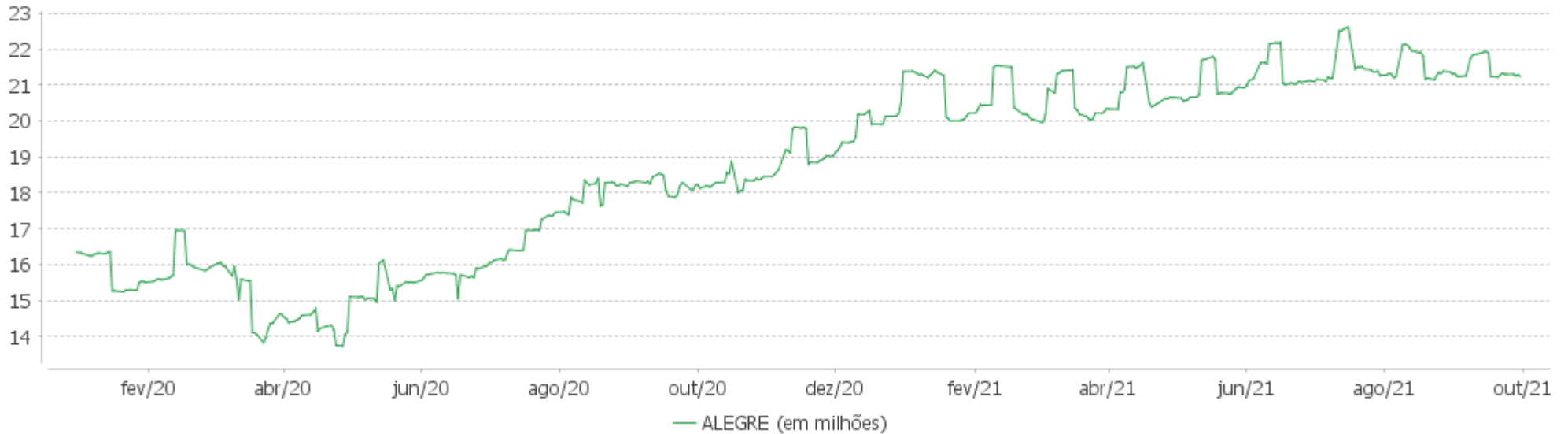
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	6	28,57	03 meses	-1,48	4,42	-5,90	3,78
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	71,43	06 meses	0,44	7,56	-7,12	3,68
			12 meses	3,90	16,33	-12,43	3,79
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,54	2020-12	Desde 31/12/2019	3,03	23,13	-20,10	7,66
Menor rentabilidade da Carteira	-5,47	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

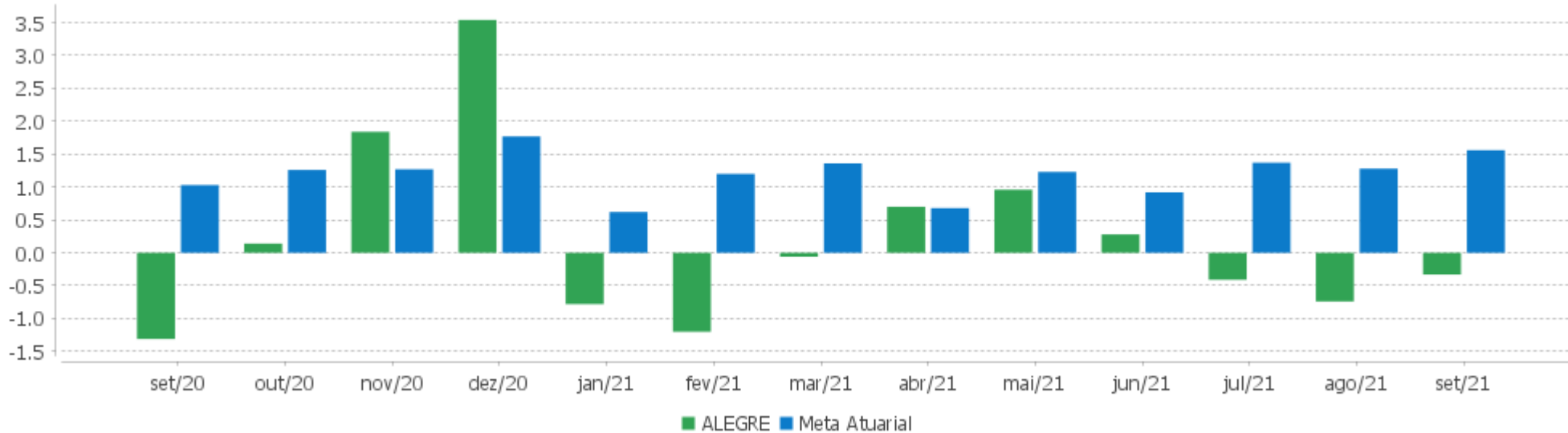


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo 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.	-0,60 -0,47	-6,88 -4,58	-2,79 -1,20	0,37 -0,15	3,32 -1,39	-5,79 -12,71	32,71 -7,75
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,46 104,77	2,64 105,40	1,31 106,72	2,13 105,74	3,23 107,92	6,30 94,70	12,80 95,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,11 -1,05	-0,85 -7,75	-0,46 -3,48	0,90 -3,85	2,78 -7,47		
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,02	-2,51 -0,21	-1,68 -0,09	0,37 -0,15	4,45 -0,26	6,20 -0,72	39,29 -1,17
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,74	-7,23 -4,93	-3,51 -1,92	-0,95 -1,47	2,86 -1,85	-4,59 -11,51	37,72 -2,74
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-1,38 -0,62	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,37 -0,04	1,53 -0,25	0,87 -0,09	1,47 -0,18	2,16 -0,33	6,42 -0,73	14,11 -1,01
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,46 -0,16	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-6,87 -0,24	-4,33 -0,14	-1,81 -0,20	2,97 -0,24	0,80 -0,67	45,16 -1,83
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,05 -0,48	-8,20 -1,45	-14,12 -1,64	-5,86 -1,01	14,97 -2,34	0,89 -5,06	28,85 -11,02
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-7,71 -1,15	-3,23 3,53	-14,35 -1,87	-5,38 -0,53	16,49 -0,82	8,55 2,60	
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-6,04 0,53	-10,92 -4,17	-14,46 -1,98	-7,63 -2,78	7,38 -9,93	-10,29 -16,24	22,14 -17,73
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,52 4,05	-2,28 4,48	-6,51 5,97	0,33 5,18	29,38 12,07	17,40 11,45	82,81 42,94
ALEGRE Var. IPCA + 4,81% p.p.	-0,33 -1,89	-1,59 -12,31	-1,48 -5,75	0,44 -6,82	3,90 -11,63		
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
58	08/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	595.000,00	0,00	252.724,35903300	2,3543436900
60	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.500,00	2.837,79923300	2,6428930000
57	17/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	584.804,00	248.027,70359600	2,3578172580
61	17/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.000,00	12.457,07066600	2,6490980000
62	22/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.066,73	0,00	13.979,55342900	2,6514960000
59	23/09/2021	BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.452,00	0,00	85,53133600	16,9762341470
Total			633.518,73	625.304,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 398.598,65

Value-At-Risk: 1,88%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALEGRE		1,88	1,88			21.241.634,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,69%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		3,54	0,07	0,72			427.222,84	2,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,18	0,00	0,01			1.078.975,79	5,08
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,97	0,46	0,04			3.366.798,47	15,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,30	0,02			2.247.317,90	10,58
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,18	0,00	0,00			418.439,61	1,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,07	0,35	0,07			1.918.150,26	9,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,12	0,19			2.446.390,40	11,52
Sub-total	3,89	2,40	1,31		-0,18	-0,26	11.903.295,27	56,04

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		3,57	0,01	0,74			92.060,19	0,43
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,03	0,00	0,02			3.298.658,32	15,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,14	0,24	1,14			4.904.584,60	23,09
Sub-total	0,89	0,71	0,26		-0,23	0,23	8.295.303,11	39,05

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,24%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		9,42	0,07	3,20			225.874,53	1,06
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		9,50	0,06	1,75			209.463,29	0,99
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		9,83	0,12	2,64			425.983,94	2,01
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		8,64	0,05	3,56			181.714,80	0,86
Sub-total	25,59	9,24	0,30		-0,22	-5,15	1.043.036,56	4,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, setembro de 2021:

- O instituto está com 23,09% do patrimônio líquido do fundo BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI (Art. 7, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;