



LDB
EMPRESAS

ALEGRE
JUNHO 2023



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 30.06.2023.

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 91,40%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,48	0,36	1,80	8,76	3.593.525,94	10,80	5.696.060.085,44	0,06
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,42	0,00	0,00	0,00	4.000.000,00	12,02	4.459.933.733,33	0,09
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	1.832.633,29	5,51	6.781.214.720,11	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,28	0,74	2,37	11,28	3.392.250,10	10,20	6.493.608.770,37	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,35	0,73	2,35	11,24	1.716.328,82	5,16	4.240.209.456,14	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,07	1,16	6,59	1.794.995,22	5,39	7.342.301.496,88	0,02
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,17	1,02	6,56	1.817.799,39	5,46	6.483.473.627,64	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,26	1,10	3,30	14,47	1.129.723,31	3,40	1.220.487.574,87	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41	0,23	1,03	6,99	1.289.757,17	3,88	5.638.426.224,35	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,39	0,06	0,93	5,56	2.144.906,39	6,45	3.511.010.528,94	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,11	0,39	1,69	8,59	22.711.919,63	68,26		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,09	6,44	3.731.757,39	11,22	14.982.085.274,92	0,02
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,71	0,05	1,13	4,16	3.966.698,57	11,92	2.672.838.297,96	0,15
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,32	0,05	1,11	5,54	7.698.455,96	23,14		
Renda Fixa			2,33	0,26	1,47	7,49	30.410.375,59	91,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,40%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	21,01	-0,45	8,96	5,17	94.590,50	0,28	1.365.623.732,74	0,01
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,05	0,08	7,90	7,28	394.253,23	1,18	592.169.733,93	0,07
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,16	-0,25	8,88	6,51	96.384,21	0,29	810.368.157,20	0,01
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,21	-0,39	8,37	6,56	218.804,36	0,66	326.744.018,15	0,07
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,58	-0,44	8,18	4,06	417.013,33	1,25	876.317.823,44	0,05
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,67	1,01	5,85	0,53	92.178,20	0,28	342.392.350,57	0,03
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	21,71	-0,58	7,40	2,75	150.744,48	0,45	843.231.031,13	0,02
Sub-total Artigo 8º I			19,60	-0,20	8,00	5,14	1.463.968,31	4,40		
Renda Variável			19,60	-0,20	8,00	5,14	1.463.968,31	4,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,59%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	21,98	0,17	1,47	7,68	197.833,68	0,59	1.281.910.332,14	0,02
Sub-total Artigo 9º III			21,98	0,17	1,47	7,68	197.833,68	0,59		
Investimentos no Exterior			21,98	0,17	1,47	7,68	197.833,68	0,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,61%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,45	0,11	1,19	6,37	1.199.676,39	3,61	17.192.710.135,50	0,01
Sub-total Artigo 10º I			0,45	0,11	1,19	6,37	1.199.676,39	3,61		
Investimentos Estruturados			0,45	0,11	1,19	6,37	1.199.676,39	3,61		
Total			2,77	0,23	1,75	7,32	33.271.853,97	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	366.325,48
Sub-total Disponibilidades Financeiras	366.325,48
Total	33.805.554,45

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	22.711.919,63	68,26					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	7.698.455,96	23,14					60,00
	Total Renda Fixa	30.410.375,59	91,40					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	1.463.968,31	4,40					30,00
	Total Renda Variável	1.463.968,31	4,40					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	197.833,68	0,59					10,00
	Total Investimentos no Exterior	197.833,68	0,59					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.199.676,39	3,61					10,00
	Total Investimentos Estruturados	1.199.676,39	3,61					15,00
Total		33.271.853,97	100,00					

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	1,69 157,46	8,59 132,12	4,64 147,54	8,59 132,12	12,25 90,46	310.791,16	1.495.984,92
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,11 103,33	5,54 85,26	3,11 98,82	5,54 85,26	12,53 92,53	120.690,12	519.336,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,00 -1,01	5,14 -2,47	12,94 -2,97	5,14 -2,47	12,14 -7,69	108.397,23	71.573,02
Artigo 9º III % do CDI	1,47 137,05	7,68 118,25	4,07 129,41	7,68 118,25	10,43 77,01	2.864,34	14.118,21
Artigo 10º I % do CDI	1,19 111,08	6,37 97,98	3,23 102,70	6,37 97,98	12,61 93,11	14.116,79	71.813,33
ALEGRE (Total)						556.859,64	2.172.826,28

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\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3.529.842,58	0,00	0,00	0,00	3.593.525,94	63.683,36	288.295,72
BB PREV RF IDKA2	1.799.453,92	0,00	0,00	0,00	1.817.799,39	18.345,47	111.940,69
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.313.648,42	0,00	0,00	0,00	3.392.250,10	78.601,68	343.853,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.276.596,55	0,00	0,00	0,00	1.289.757,17	13.160,62	84.258,94
BB PREV RF IRF M	0,00	4.000.000,00	0,00	0,00	4.000.000,00	0,00	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.811.643,95	0,00	0,00	0,00	1.832.633,29	20.989,34	111.692,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.125.118,53	0,00	0,00	0,00	2.144.906,39	19.787,86	114.362,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.093.671,95	0,00	0,00	0,00	1.129.723,31	36.051,36	142.833,61
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.676.864,63	0,00	0,00	0,00	1.716.328,82	39.464,19	173.477,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.796.787,94	0,00	-22.500,00	0,00	1.794.995,22	20.707,28	118.281,60
					22.711.919,63	310.791,16	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	3.996.789,10	0,00	-75.000,00	0,00	3.966.698,57	44.909,47	143.212,65
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.074.776,29	1.581.200,45	-4.000.000,00	0,00	3.731.757,39	75.780,65	376.124,15
					7.698.455,96	120.690,12	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES AGRO FIC FI	87.081,56	0,00	0,00	0,00	92.178,20	5.096,64	488,64
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	201.899,04	0,00	0,00	0,00	218.804,36	16.905,32	13.476,52
BB AÇÕES DIVIDENDOS	365.401,97	0,00	0,00	0,00	394.253,23	28.851,26	26.763,63
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	88.525,44	0,00	0,00	0,00	96.384,21	7.858,77	5.892,56
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	140.362,50	0,00	0,00	0,00	150.744,48	10.381,98	4.033,37
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	86.810,71	0,00	0,00	0,00	94.590,50	7.779,79	4.647,71
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	385.489,86	0,00	0,00	0,00	417.013,33	31.523,47	16.270,59
					1.463.968,31	108.397,23	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	194.969,34	0,00	0,00	0,00	197.833,68	2.864,34	14.118,21
					197.833,68	2.864,34	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	1.185.559,60	0,00	0,00	0,00	1.199.676,39	14.116,79	71.813,33
					1.199.676,39	14.116,79	

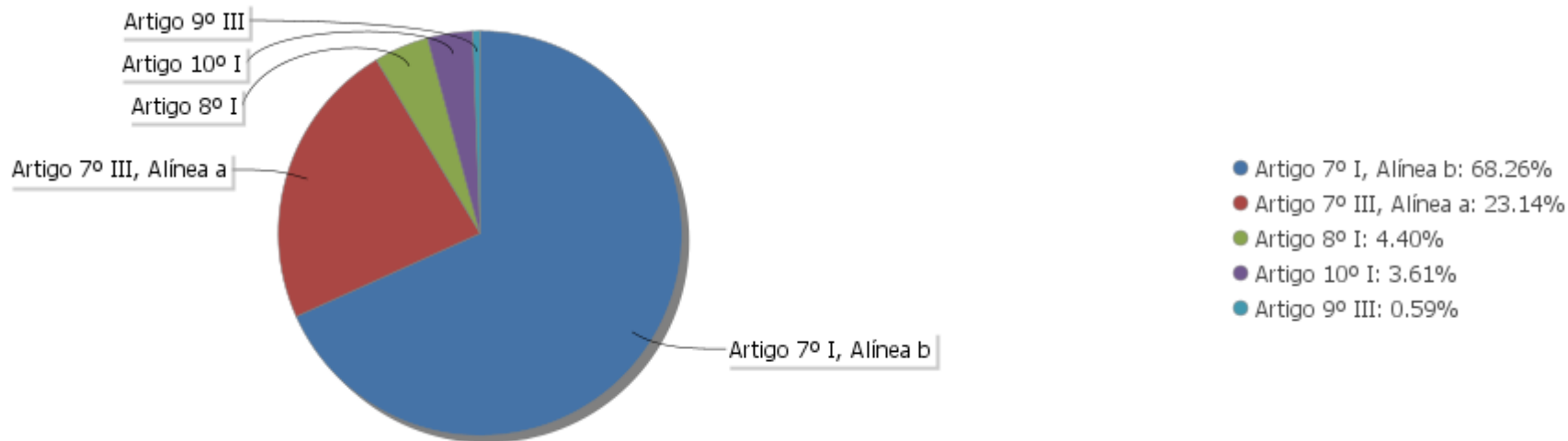
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

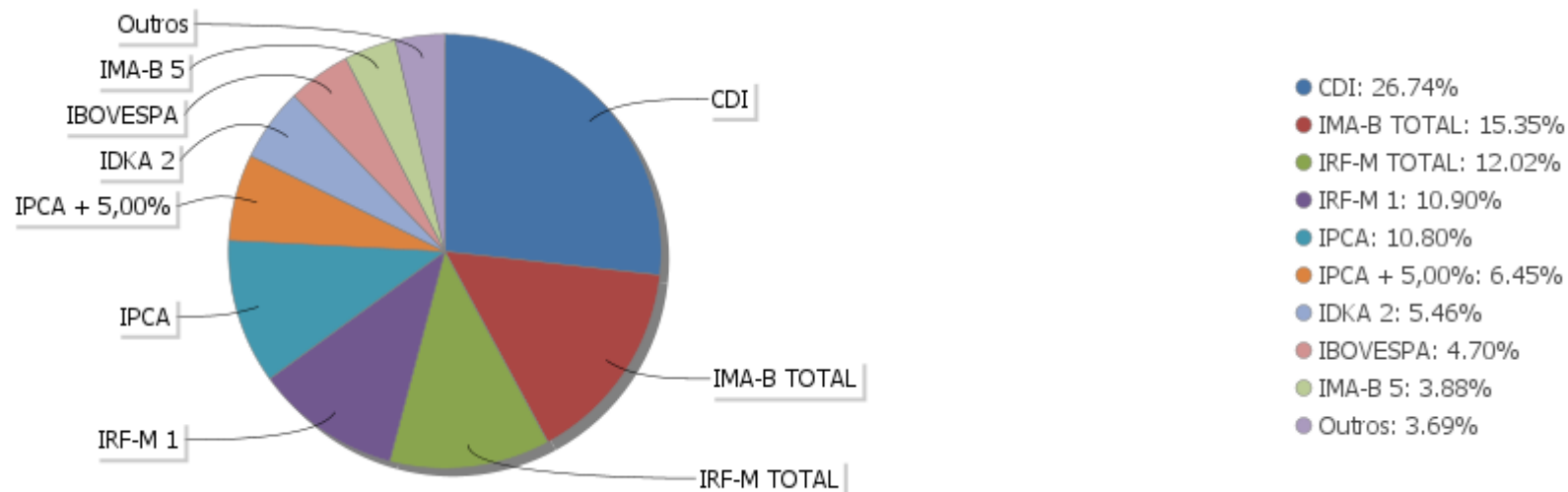
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	30.709.934,25	92,30	30.709.934,25	92,30	
de 31 dias a 365 dias	417.013,33	1,25	31.126.947,58	93,55	
acima de 365 dias	2.144.906,39	6,45	33.271.853,97	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

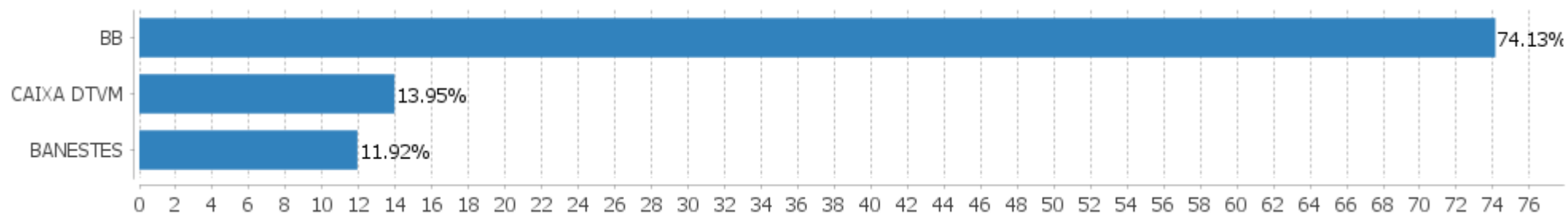


Alocação Por Estratégia



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
2023	0,83	0,54	1,36	1,15	1,49	1,75							7,32
IPCA + 4,81%	0,94	1,18	1,14	0,95	0,64	0,31							5,28
p.p. indexador	-0,11	-0,64	0,22	0,20	0,84	1,43							2,05
2022	0,16	0,55	1,88	0,16	1,02	-0,44	0,22	1,23	0,97	1,42	-0,14	0,52	7,80
IPCA + 4,81%	0,93	1,37	2,04	1,42	0,88	1,06	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,03	10,85
p.p. indexador	-0,77	-0,82	-0,16	-1,26	0,14	-1,50	0,51	1,16	0,87	0,45	-0,92	-0,51	-3,06
2021	-0,78	-1,20	-0,06	0,70	0,96	0,28	-0,41	-0,74	-0,33	-1,75	1,93	0,68	-0,78
IPCA + 5,39%	0,67	1,24	1,41	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67	1,37	1,21	15,97
p.p. indexador	-1,45	-2,44	-1,47	-0,03	-0,32	-0,69	-1,84	-2,07	-1,94	-3,43	0,56	-0,53	-16,75
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

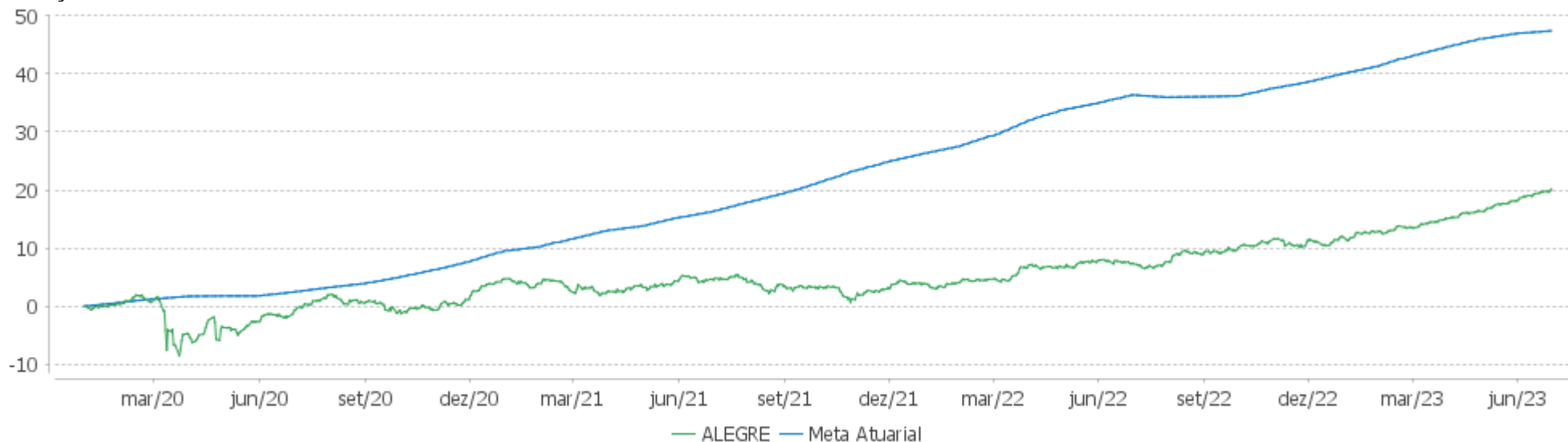
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

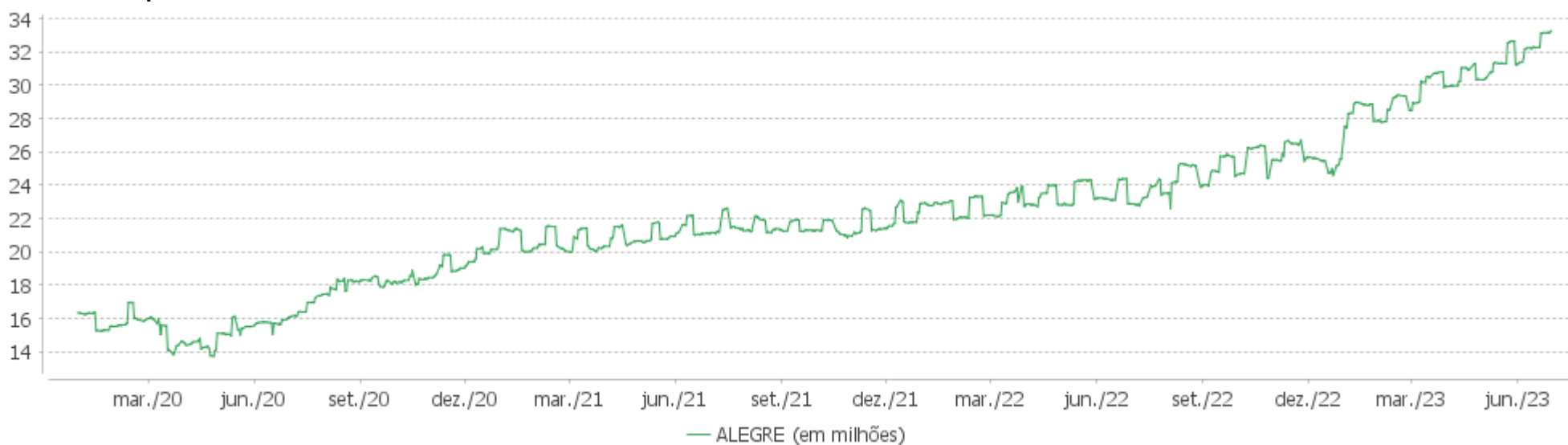
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	38,10	03 meses	4,44	1,91	2,53	1,49
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	61,90	06 meses	7,32	5,28	2,05	1,99
			12 meses	11,93	8,10	3,82	2,77
			24 meses	14,92	27,13	-12,20	3,13
			36 meses	21,71	45,56	-23,84	3,47
Maior rentabilidade da Carteira	3,54	2020-12	Desde 31/12/2019	20,19	49,90	-29,72	5,82
Menor rentabilidade da Carteira	-5,47	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

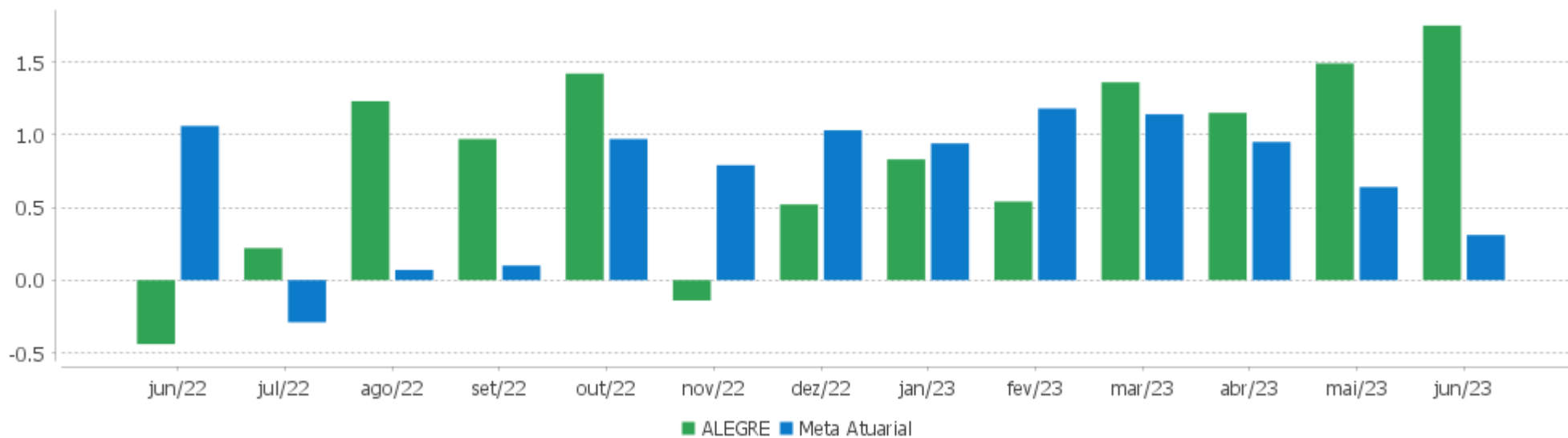


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,35 -0,04	11,24 -0,12	7,06 -0,04	11,24 -0,12	13,32 -0,21	17,31 -0,50	25,74 -0,82
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,02 0,05	6,56 -0,22	2,10 0,11	6,56 -0,22	9,43 0,15	20,20 -0,12	27,87 -0,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,49 -0,18	3,14 -0,08	6,49 -0,18	13,48 -0,34	21,33 -0,67	23,34 -1,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,99 -0,05	2,56 0,01	6,99 -0,05	10,05 -0,18	20,76 -0,56	27,74 -0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,80 1,88	8,76 5,89	5,04 4,28	8,76 5,89	13,97 10,81	19,98 4,55	23,84 -1,22
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,09 -0,03	9,44 -0,18	5,43 -0,08	9,44 -0,18	16,38 -0,36	18,13 -0,66	18,03 -0,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 0,60	5,56 0,19	1,44 -0,52	5,56 0,19	8,39 0,10		
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,28 -0,09	7,11 0,01	11,28 -0,09	13,29 -0,24	17,23 -0,58	25,61 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,30 -0,07	14,47 -0,44	10,61 -0,30	14,47 -0,44	15,72 -0,62	12,70 -1,12	22,09 -1,43
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,13 105,76	4,16 63,94	3,01 95,58	4,16 63,94	11,28 83,32	21,83 93,41	26,31 100,54
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,92	6,44 99,04	3,16 100,55	6,44 99,04	13,54 99,98	23,74 101,59	26,65 101,82
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,37 -0,63	6,56 -1,05	13,83 -2,07	6,56 -1,05	16,30 -3,53	-10,29 -3,42	19,35 -4,88
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	5,85 -3,15	0,53 -7,08	8,15 -7,75	0,53 -7,08	7,13 -12,70	-4,48 2,39	
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	8,96 -0,04	5,17 -2,44	14,28 -1,63	5,17 -2,44	12,53 -7,31	-7,54 -0,67	29,14 4,91
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	7,90 -1,11	7,28 -0,33	14,22 -1,69	7,28 -0,33	14,52 -5,32	-7,08 -0,21	14,65 -9,58
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	19,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IGCT p.p.	-0,16	-1,00	-0,67	-1,00	-1,81	-2,14	-4,20
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	7,40	2,75	10,27	2,75	6,15	-28,95	-4,71
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	-4,86	-5,63	-4,86	-13,69	-22,08	-28,94
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	8,18	4,06	12,50	4,06	9,81	-8,47	23,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,82	-3,55	-3,40	-3,55	-10,02	-1,60	-0,48
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	1,47	7,68	4,07	7,68	10,43	-0,84	23,27
Var. IBOVESPA p.p.	-7,53	0,07	-11,83	0,07	-9,41	6,04	-0,96
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	1,19	6,37	3,23	6,37	12,61	22,16	26,53
% do CDI	111,08	97,98	102,70	97,98	93,11	94,83	101,38
ALEGRE	1,75	7,32	4,44	7,32	11,93	14,92	21,71
Var. IPCA + 4,81% p.p.	1,43	2,05	2,53	2,05	3,82	-11,85	-22,22
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB AÇÕES AGRO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+2	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice IBOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
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 ESG FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	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 SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI			D+1 du	D+1 du		0,50
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF IRF M	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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
284	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	196.000,00	0,00	68.517,67630600	2,8605757020
285	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.000,00	0,00	3.495,79981100	2,8605757020
286	07/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	556.600,00	0,00	194.476,18644800	2,8620470720
288	07/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.600,45	0,00	1.257,99817700	2,8620470720
289	16/06/2023	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	75.000,00	35.207,39360719	2,1302343700
281	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.500,00	7.070,75780200	3,1821200000
287	21/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	815.000,00	0,00	283.432,33201500	2,8754658800
282	30/06/2023	BB PREV RF IRF M	4.000.000,00	0,00	560.284,51286700	7,1392299950
283	30/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.386.082,61928000	2,8858308620
Total			5.581.200,45	4.097.500,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 307.525,93

Value-At-Risk: 0,92%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALEGRE		0,92	0,92			33.271.853,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,81%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,91	0,09	0,92			3.593.525,94	10,80
BB PREV RF IRF M		1,22	0,13	0,02			4.000.000,00	12,02
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,21	0,01	0,01			1.832.633,29	5,51
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,83	0,17	0,04			3.392.250,10	10,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,09	0,04			1.716.328,82	5,16
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,01	0,01			1.794.995,22	5,39
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,04	0,15			1.817.799,39	5,46
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,31	0,10	0,17			1.129.723,31	3,40
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,92	0,03	0,03			1.289.757,17	3,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,83	0,03	0,82			2.144.906,39	6,45
Sub-total	2,32	1,08	0,69		0,27	1,69	22.711.919,63	68,26

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			3.731.757,39	11,22
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,16	0,00	0,16			3.966.698,57	11,92
Sub-total	0,02	0,09	0,00		2,34	1,11	7.698.455,96	23,14

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,99%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		8,32	0,02	0,96			94.590,50	0,28
BB AÇÕES DIVIDENDOS		7,86	0,06	2,26			394.253,23	1,18
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,36	0,02	0,23			96.384,21	0,29
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		8,25	0,04	1,38			218.804,36	0,66
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		8,13	0,07	1,26			417.013,33	1,25
BB AÇÕES AGRO FIC FI		8,05	0,01	5,27			92.178,20	0,28
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		8,85	0,03	1,89			150.744,48	0,45
Sub-total	14,85	7,99	0,24		0,47	8,00	1.463.968,31	4,40

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,20%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI		0,20	0,00	0,20			1.199.676,39	3,61
Sub-total	0,34	0,20	0,00		0,35	1,19	1.199.676,39	3,61

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,70%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I		6,70	-0,01	11,28			197.833,68	0,59
Sub-total	14,11	6,70	-0,01		0,03	1,47	197.833,68	0,59