



**LDB**  
EMPRESAS

**ALEGRE**  
OUTUBRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.10.2024.

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 91,60%

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO	1,68	0,01	0,71	4,97	2.624.250,95	5,86	29.150.602,46	9,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,04	0,75	7,45	2.059.091,61	4,60	6.119.978.979,94	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,67	0,10	-0,67	-0,08	1.538.606,14	3,43	4.070.369.176,30	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,62	0,02	0,72	5,81	1.427.805,02	3,19	4.542.033.919,19	0,03
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,61	-0,04	0,19	3,90	3.391.923,20	7,57	3.147.997.721,72	0,11
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,41	0,04	0,82	7,85	4.481.358,21	10,00	8.415.592.732,29	0,05
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	0,01	0,81	5,91	2.018.496,90	4,51	4.919.072.193,80	0,04
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,76	0,07	1,16	4,55	5.060.796,50	11,30	1.342.605.683,75	0,38
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,99	0,02	0,89	2,93	3.555.895,27	7,94	3.760.040.315,03	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,68	0,16	-1,65	-4,32	1.868.684,09	4,17	1.114.378.615,42	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,67	0,10	-0,68	-0,06	1.867.958,71	4,17	3.355.089.991,95	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,04	0,83	7,99	2.443.320,83	5,45	8.121.204.821,20	0,03
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,65</b>	<b>0,04</b>	<b>0,49</b>	<b>5,06</b>	<b>32.338.187,43</b>	<b>72,19</b>		

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,07	0,04	0,93	9,44	5.123.063,98	11,44	3.362.430.669,92	0,15
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,93	9,12	3.571.985,30	7,97	20.409.457.658,47	0,02
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,05</b>	<b>0,04</b>	<b>0,93</b>	<b>9,33</b>	<b>8.695.049,28</b>	<b>19,41</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,32

0,04

0,58

5,93

41.033.236,71

91,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,48%

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 AGRO FIC FI	15,55	-0,76	-0,15	-6,52	94.903,20	0,21	191.452.290,78	0,05
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	11,62	-0,55	-1,57	-1,55	445.220,65	0,99	570.077.421,03	0,08
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	13,92	-0,54	-1,33	-0,80	116.798,95	0,26	789.349.967,85	0,01
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	12,22	-0,64	-1,49	-3,03	105.503,64	0,24	632.719.373,43	0,02
BB	BB	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	13,22	-0,48	-0,28	-0,28	161.722,98	0,36	833.908.897,61	0,02
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	12,50	0,00	0,88	-5,59	0,00	0,00	0,00	
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,10	-0,77	-1,02	-8,59	97.789,69	0,22	1.072.264.613,08	0,01
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	21,81	-0,85	0,78	-17,69	93.334,74	0,21	233.528.233,16	0,04
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,04	-0,66	-1,45	-5,34	442.589,95	0,99	718.333.078,98	0,06
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>12,26</b>	<b>-0,63</b>	<b>-1,03</b>	<b>-5,02</b>	<b>1.557.863,80</b>	<b>3,48</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>12,26</b>	<b>-0,63</b>	<b>-1,03</b>	<b>-5,02</b>	<b>1.557.863,80</b>	<b>3,48</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,67%

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 GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	15,20	-1,37	5,61	38,96	300.661,14	0,67	1.663.682.764,36	0,02
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,20</b>	<b>-1,37</b>	<b>5,61</b>	<b>38,96</b>	<b>300.661,14</b>	<b>0,67</b>		
Investimentos no Exterior			15,20	-1,37	5,61	38,96	300.661,14	0,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,25%

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	0,70	0,02	0,77	6,95	1.603.185,71	3,58	10.840.726.544,22	0,01
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,28	-0,14	0,57	0,36	301.068,38	0,67	443.407.585,42	0,07
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>0,74</b>	<b>-0,00</b>	<b>0,73</b>	<b>6,87</b>	<b>1.904.254,09</b>	<b>4,25</b>		
Investimentos Estruturados			0,74	-0,00	0,73	6,87	1.904.254,09	4,25		
<b>Total</b>			<b>1,53</b>	<b>0,01</b>	<b>0,56</b>	<b>5,71</b>	<b>44.796.015,74</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	55.075,64
<b>Sub-total Disponibilidades Financeiras</b>	<b>55.075,64</b>
<b>Total</b>	<b>45.018.466,38</b>



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	32.338.187,43	72,19	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	8.695.049,28	19,41	0,00	22,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>41.033.236,71</b>	<b>91,60</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	1.557.863,80	3,48	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.557.863,80</b>	<b>3,48</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	300.661,14	0,67	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>300.661,14</b>	<b>0,67</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.904.254,09	4,25	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>1.904.254,09</b>	<b>4,25</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>44.796.015,74</b>	<b>100,00</b>					

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	0,49 52,69	5,06 56,27	1,58 59,73	3,86 73,32	8,75 79,70	157.535,55	1.555.429,83
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 100,30	9,33 103,72	2,73 102,99	5,46 103,56	11,37 103,60	80.612,30	717.854,28
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,03 0,56	-5,02 -1,69	1,32 -0,29	2,55 -0,46	12,11 -2,54	-16.238,63	-82.203,17
Artigo 9º III % do CDI	5,61 604,99	38,96 433,21	7,27 274,06	24,51 465,03	51,92 472,94	15.981,77	84.289,87
Artigo 10º I % do CDI	0,73 79,18	6,87 76,43	2,25 84,91	4,27 81,00	9,38 85,41	13.890,00	105.215,63
<b>ALEGRE (Total)</b>						<b>251.780,99</b>	<b>2.380.586,44</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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO	2.605.798,56	0,00	0,00	0,00	2.624.250,95	18.452,39	124.250,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2.043.798,62	0,00	0,00	0,00	2.059.091,61	15.292,99	237.499,15
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.543.049,28	5.964,71	0,00	0,00	1.538.606,14	-10.407,85	-5.286,81
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.417.639,70	0,00	0,00	0,00	1.427.805,02	10.165,32	78.456,11
BB PREV RF IRF M	3.385.568,72	0,00	0,00	0,00	3.391.923,20	6.354,48	150.002,39
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.445.052,58	0,00	0,00	0,00	4.481.358,21	36.305,63	345.591,80
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.002.304,34	0,00	0,00	0,00	2.018.496,90	16.192,56	112.634,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	5.002.956,98	0,00	0,00	0,00	5.060.796,50	57.839,52	162.567,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	3.524.527,89	0,00	0,00	0,00	3.555.895,27	31.367,38	83.599,32
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.900.130,18	0,00	0,00	0,00	1.868.684,09	-31.446,09	-84.306,06
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.880.777,35	0,00	0,00	0,00	1.867.958,71	-12.818,64	-1.029,83
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.484.082,97	0,00	-61.000,00	0,00	2.443.320,83	20.237,86	193.022,33

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	32.235.687,17	5.964,71	-61.000,00	0,00	32.338.187,43	157.535,55	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	5.175.520,66	0,00	-100.000,00	0,00	5.123.063,98	47.543,32	470.341,48
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.945.098,90	2.075.000,00	-1.481.182,58	0,00	3.571.985,30	33.068,98	247.512,80
	8.120.619,56	2.075.000,00	-1.581.182,58	0,00	8.695.049,28	80.612,30	

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	95.046,94	0,00	0,00	0,00	94.903,20	-143,74	-6.615,12
BB AÇÕES DIVIDENDOS	452.322,46	0,00	0,00	0,00	445.220,65	-7.101,81	-7.090,90
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	118.374,55	0,00	0,00	0,00	116.798,95	-1.575,60	-936,55
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	107.097,62	0,00	0,00	0,00	105.503,64	-1.593,98	-3.291,74
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	0,00	162.173,96	0,00	0,00	161.722,98	-450,98	-450,98
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	160.754,13	0,00	-162.173,96	0,00	0,00	1.419,83	-9.606,82
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	98.792,75	0,00	0,00	0,00	97.789,69	-1.003,06	-9.185,48
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	92.614,28	0,00	0,00	0,00	93.334,74	720,46	-20.055,97
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	449.099,70	0,00	0,00	0,00	442.589,95	-6.509,75	-24.969,61
	1.574.102,43	162.173,96	-162.173,96	0,00	1.557.863,80	-16.238,63	

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 GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	284.679,37	0,00	0,00	0,00	300.661,14	15.981,77	84.289,87
	284.679,37	0,00	0,00	0,00	300.661,14	15.981,77	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	1.590.996,13	0,00	0,00	0,00	1.603.185,71	12.189,58	104.147,25
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	299.367,96	0,00	0,00	0,00	301.068,38	1.700,42	1.068,38
	1.890.364,09	0,00	0,00	0,00	1.904.254,09	13.890,00	

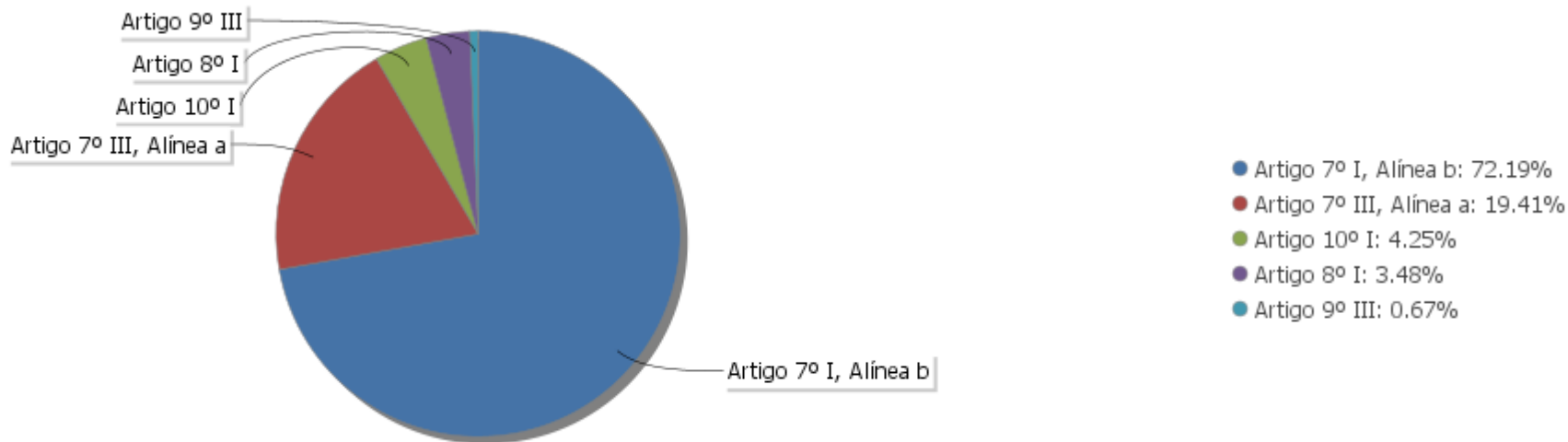
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Liquidez**

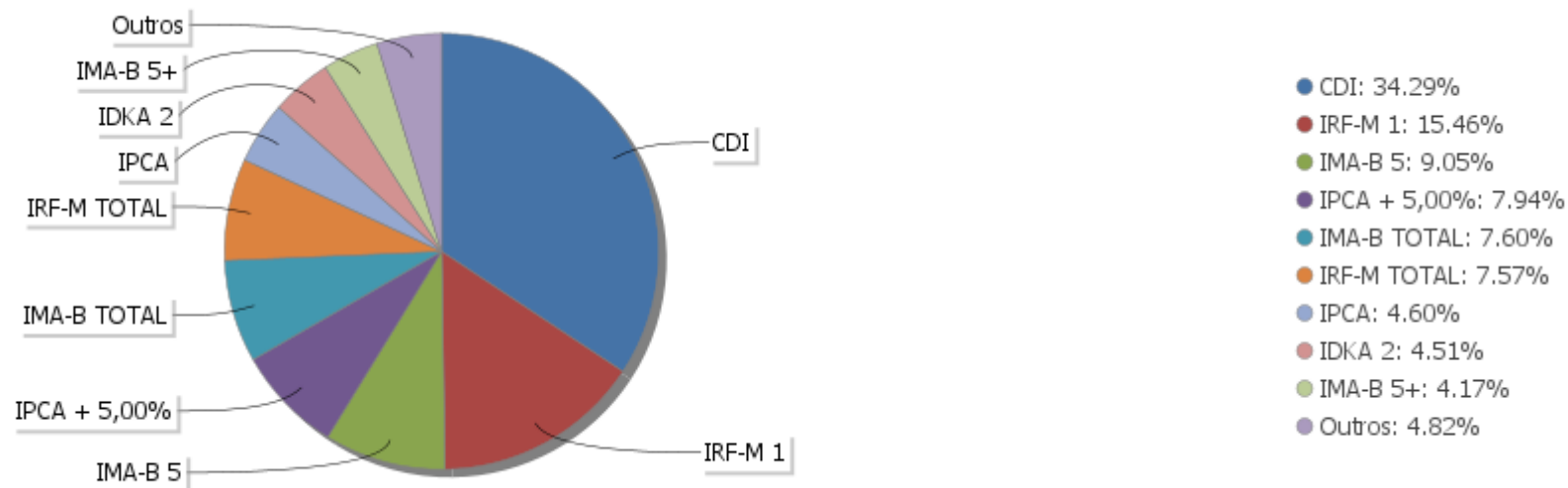
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	35.435.665,64	79,10	92,59	35.435.665,64	79,10	92,59
de 31 dias a 365 dias	5.804.454,83	12,96	7,41	41.240.120,47	92,06	100,00
acima de 365 dias	3.555.895,27	7,94		44.796.015,74	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

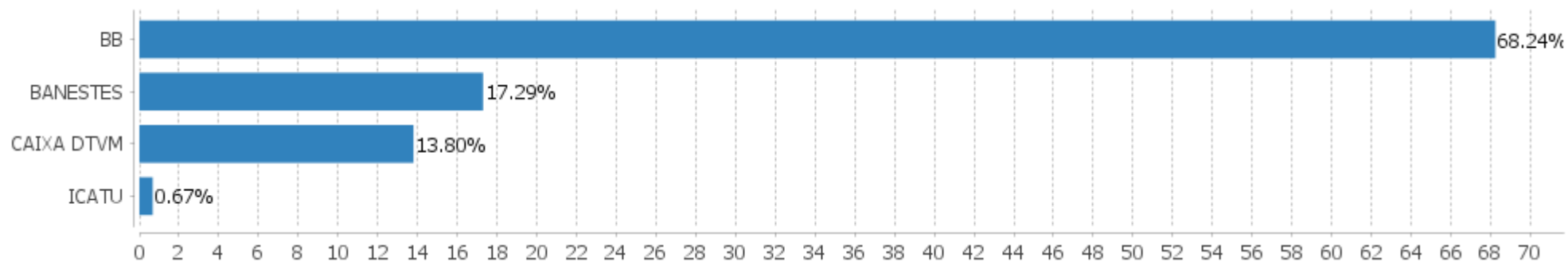


Alocação Por Estratégia



## 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
2024	0,37	0,71	0,58	-0,27	0,83	0,31	1,19	0,93	0,36	0,56			5,71
IPCA + 4,90%	0,84	1,19	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84	1,00			8,17
p.p. indexador	-0,47	-0,48	0,04	-1,07	-0,03	-0,28	0,37	0,53	-0,48	-0,44			-2,46
2023	0,83	0,54	1,36	1,15	1,49	1,75	1,06	0,39	0,29	0,13	2,03	1,69	13,45
IPCA + 4,93%	0,95	1,19	1,15	0,96	0,65	0,32	0,52	0,67	0,64	0,64	0,66	0,94	9,72
p.p. indexador	-0,12	-0,65	0,21	0,19	0,83	1,42	0,54	-0,28	-0,35	-0,51	1,37	0,74	3,73
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	-3,05
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. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	22	37,93
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	62,07

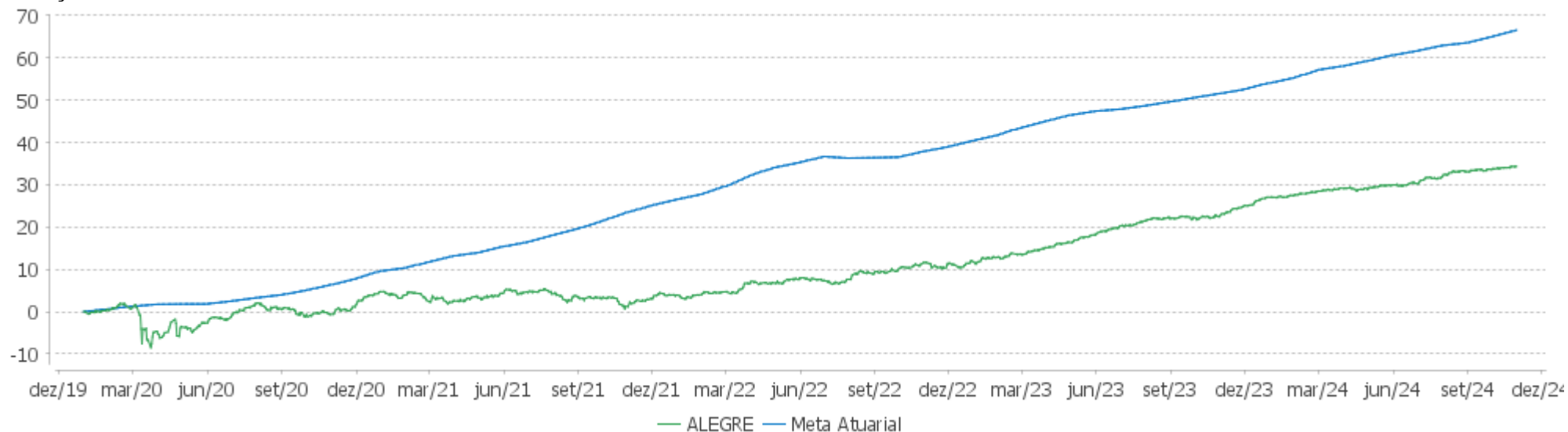
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,54	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,47	2020-03

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,86	2,26	-0,39	1,44
06 meses	4,25	4,60	-0,34	1,53
12 meses	9,68	9,92	-0,24	1,53
24 meses	20,39	20,85	-0,45	2,03
36 meses	32,68	34,98	-2,30	2,42
48 meses	35,25	57,53	-22,27	2,87
Desde 31/12/2019	34,31	68,99	-34,68	5,03

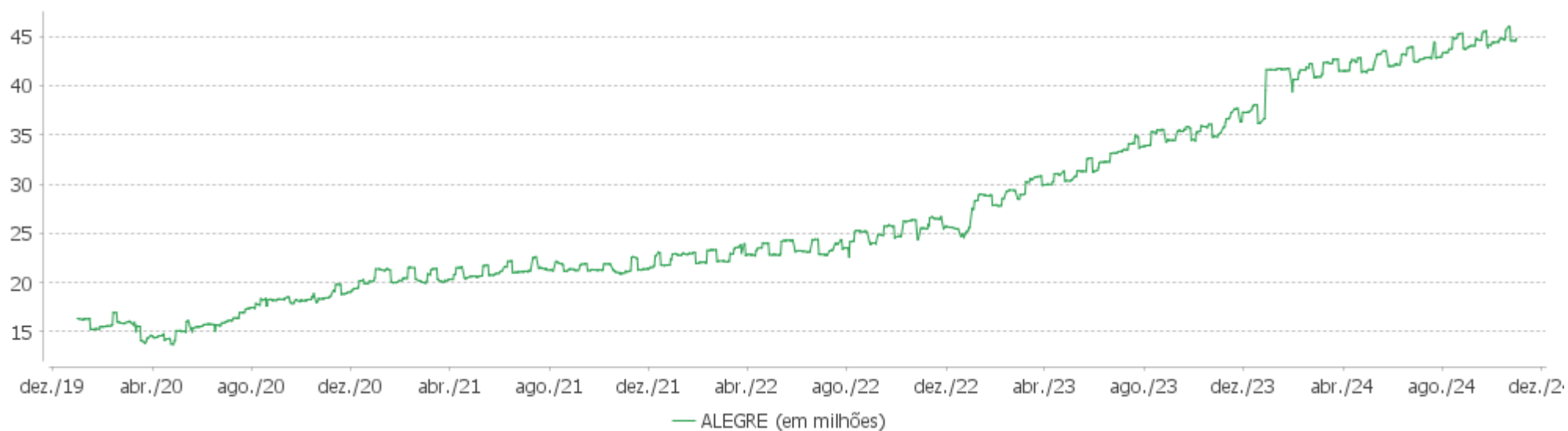


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

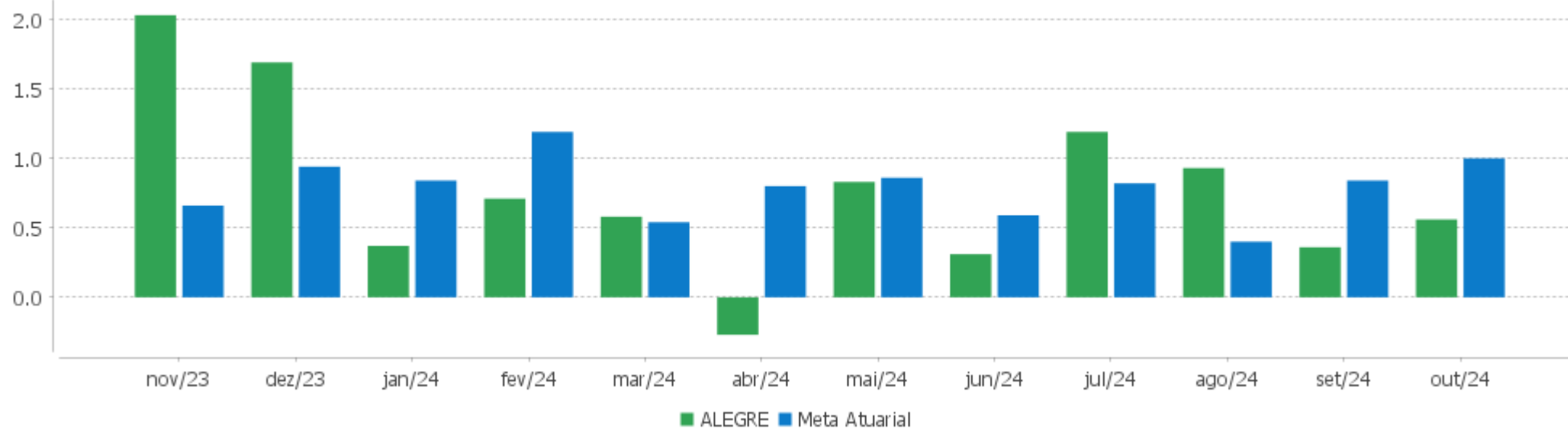


Patrimônio Líquido



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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	1,16 124,59	5,14 104,08	3,07 115,59				
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,68 -0,03	-0,06 -0,22	-0,87 -0,07	1,48 -0,15	5,35 -0,27	14,56 -0,54	27,46 -0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,81 0,00	5,91 0,05	1,93 0,13	4,06 0,21	9,33 -0,05	18,99 -0,26	33,44 -0,71
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,89 -0,12	3,29 -0,97	2,01 -0,28				
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,82 -0,03	7,85 -0,23	2,38 -0,08	4,70 -0,18	9,86 -0,30	24,28 -0,73	38,24 -1,17
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,72 -0,02	5,81 -0,27	1,62 -0,12	3,97 -0,18	9,26 -0,31	19,08 -0,58	33,93 -0,97
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,83 -0,02	7,99 -0,10	2,40 -0,05	4,77 -0,11	10,00 -0,15	24,59 -0,42	38,60 -0,80
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,19 -0,02	3,90 -0,22	1,16 -0,05	2,82 -0,12	8,01 -0,26	21,47 -0,82	35,80 -1,11
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 -0,02	-0,08 -0,24	-0,90 -0,09	1,47 -0,16	5,34 -0,28	14,51 -0,59	27,21 -1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,75 0,19	7,45 3,57	2,42 1,44	4,63 2,58	9,66 4,90	24,36 14,55	38,17 21,26
BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,71 -0,03	5,67 -0,41	1,69 -0,05	3,94 -0,22	9,12 -0,46		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,65 0,00	-4,32 -0,08	-2,32 -0,01	0,07 -0,08	2,80 -0,13	11,02 -0,52	21,93 -0,93
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,93 100,00	9,44 104,94	2,75 103,78	5,50 104,27	11,52 104,96	23,95 92,59	39,05 96,81
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,93 100,55	9,12 101,45	2,69 101,41	5,38 102,04	11,11 101,23	25,94 100,28	40,79 101,14
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI Var. SMALL CAP p.p.	0,78 2,15	-17,69 -2,84	-1,84 -0,38	-5,89 -2,14	-0,75 -3,27	-17,63 -3,50	-18,10 -4,01
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 0,42	-7,43 -4,10	0,90 -0,72	1,60 -1,41	10,72 -3,93	4,05 -7,74	14,38 -10,94
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-1,33	-0,80	3,40	3,55	17,93	16,83	30,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,39	-3,25	-0,69	-3,56	-3,31	-12,02	-19,79
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 1,44	-6,52 -3,18	-0,94 -2,55	0,84 -2,17	6,87 -7,78	-4,50 -16,29	7,00 -18,33
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,02 0,58	-8,59 -5,25	0,36 -1,26	1,75 -1,26	7,22 -7,42	1,69 -10,09	10,08 -15,24
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-1,49 -0,00	-3,03 -0,29	1,34 -0,18	2,75 -0,11	14,77 -0,65	9,14 -2,41	21,34 -3,83
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-1,57 0,03	-1,55 1,78	2,81 1,19	5,05 2,04	15,79 1,15	11,65 -0,13	27,10 1,77
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	0,88 2,48	-5,59 -2,26	4,56 2,94	5,97 2,96	10,65 -4,00	-2,42 -14,21	-2,47 -27,79
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,45 0,15	-5,34 -2,01	-0,29 -1,90	1,22 -1,79	12,52 -2,12	4,48 -7,31	9,99 -15,33
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,61 7,21	38,96 42,29	7,27 5,66	24,51 21,50	51,92 37,28	65,81 54,02	24,54 -0,79
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,77 82,57	6,95 77,26	2,32 87,62	4,34 82,39	9,45 86,11	22,87 88,42	36,29 89,98
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,57 2,16	6,13 9,46	2,58 0,97	6,45 3,44	15,13 0,49	30,03 18,24	51,72 26,39
ALEGRE Var. IPCA + 4,90% p.p.	0,56 -0,44	5,71 -2,46	1,86 -0,39	4,25 -0,34	9,68 -0,24	20,39 -0,44	32,68 -2,27
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO						0,20
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 DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	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 IBOVESPA ATIVO FIC DE 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 SMALL CAPS 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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 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 IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
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 RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI						
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	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
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	2,00

**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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68

**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	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
502	01/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	228.000,00	0,00	68.816,93504600	3,3131379630
509	03/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.000,00	1.375,90340700	3,6339760000
508	07/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.000,00	1.375,20634200	3,6358180000
519	07/10/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.964,71	0,00	747,54874800	7,9790247900
518	08/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.000,00	0,00	4.517,46731500	3,3204446100
517	10/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	165.000,00	0,00	49.655,86372300	3,3228704050
505	11/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.000,00	549,55848900	3,6392850000
507	11/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.000,00	6.045,14346400	3,6392850000
516	11/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	175.000,00	0,00	52.647,07370100	3,3240214070
501	15/10/2024	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	100.000,00	40.275,29906968	2,4829114200
514	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	458.000,00	0,00	137.522,84415000	3,3303557880
515	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	472.000,00	0,00	141.726,59921200	3,3303557880
503	21/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000,00	2.740,96132400	3,6483550000
513	21/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	334.000,00	0,00	100.249,87762200	3,3316748900
504	22/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.000,00	1.369,99474400	3,6496490000
506	24/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.000,00	3.284,47584100	3,6535510000
512	24/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.470.182,58	440.731,91896200	3,3357751430
520	24/10/2024	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	162.173,96	0,00	18.037,91226000	8,9907277120
521	24/10/2024	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	162.173,96	134.378,33349800	1,2068460250
511	30/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.000,00	3.292,16551900	3,3412657830
510	31/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	228.000,00	0,00	68.209,82631100	3,3426268960
<b>Total</b>			<b>2.243.138,67</b>	<b>1.804.356,54</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 354.731,72

Value-At-Risk: 0,79%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,23	0,75	5,00	0,67	-0,28	0,58	41.033.236,71	91,60
Artigo 8º	9,50	5,49	20,00	0,12	-0,21	-1,03	1.557.863,80	3,48
Artigo 9º	13,64	10,03	20,00	-0,01	0,34	5,61	300.661,14	0,67
Artigo 10º	0,90	0,50	20,00	0,02	-0,21	0,73	1.904.254,09	4,25
ALEGRE		0,79		0,79			44.796.015,74	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,75%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO	1,86	1,15	0,06	0,15	-0,12	0,71	2.624.250,95	5,86
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,54	0,33	0,01	0,34	-0,33	0,75	2.059.091,61	4,60
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,97	2,09	0,07	0,03	-0,40	-0,67	1.538.606,14	3,43
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,86	1,03	0,03	0,04	-0,11	0,72	1.427.805,02	3,19
BB PREV RF IRF M	2,66	1,43	0,09	0,02	-0,28	0,19	3.391.923,20	7,57
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,30	0,24	0,02	0,01	-0,37	0,82	4.481.358,21	10,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,82	1,14	0,05	0,21	-0,07	0,81	2.018.496,90	4,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,58	0,45	0,03	0,45	0,39	1,16	5.060.796,50	11,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,79	1,19	0,08	1,19	-0,02	0,89	3.555.895,27	7,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,73	3,66	0,14	0,05	-0,45	-1,65	1.868.684,09	4,17
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,98	2,09	0,08	0,01	-0,40	-0,68	1.867.958,71	4,17
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,01	0,02	-0,34	0,83	2.443.320,83	5,45
<b>Sub-total</b>	1,55	0,96	0,67		-0,28	0,49	32.338.187,43	72,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, 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 LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,03	-0,00	0,03	0,00	0,93	5.123.063,98	11,44
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,02	0,00	0,02	0,10	0,93	3.571.985,30	7,97
<b>Sub-total</b>	0,04	0,02	-0,00		0,07	0,93	8.695.049,28	19,41

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,50%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,28	0,21	0,01	0,21	-0,58	0,77	1.603.185,71	3,58
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,77	2,51	0,01	3,88	-0,08	0,57	301.068,38	0,67
<b>Sub-total</b>	0,90	0,50	0,02		-0,21	0,73	1.904.254,09	4,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,49%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES AGRO FIC FI	11,96	6,85	0,01	3,88	-0,09	-0,15	94.903,20	0,21
BB AÇÕES DIVIDENDOS	9,26	5,05	0,03	2,22	-0,27	-1,57	445.220,65	0,99
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	11,89	6,12	0,01	3,75	-0,19	-1,33	116.798,95	0,26
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	9,58	5,87	0,01	0,34	-0,25	-1,49	105.503,64	0,24
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	9,34	5,52	0,01	1,44	-0,23	-1,18	161.722,98	0,36
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	8,02	NaN	0,00	NaN	-0,01	0,88	0,00	0,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	9,35	5,31	0,01	1,47	-0,21	-1,02	97.789,69	0,22
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	16,85	12,30	0,02	3,81	-0,01	0,78	93.334,74	0,21
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,50	5,42	0,03	1,31	-0,25	-1,45	442.589,95	0,99
<b>Sub-total</b>	9,50	5,49	0,12		-0,21	-1,03	1.557.863,80	3,48

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,03%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	13,64	10,03	-0,01	10,85	0,34	5,61	300.661,14	0,67
<b>Sub-total</b>	13,64	10,03	-0,01		0,34	5,61	300.661,14	0,67

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)