



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
AGOSTO 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 11.09.2020.

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 83,48%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555	25,61	-5,39	-6,31	37.844.323,22	13,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		25,61	-5,39	-6,31	37.844.323,22	13,15

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,96	-3,55	-5,04	16.912.169,82	5,88	288.523.008,49	5,86
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	50.826.244,55	17,67	5.638.549.883,16	0,90
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	48.421.353,21	16,83	6.019.680.821,86	0,80
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	7.270.772,90	2,53	12.740.710.327,20	0,06
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	0,69	4,43	3.530.098,92	1,23	6.452.433.505,43	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,35	-3,69	-2,23	5.830.204,18	2,03	1.987.566.192,50	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,46	-3,64	-2,24	6.348.804,87	2,21	1.873.284.904,48	0,34
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,03	0,79	4,80	2.618.359,36	0,91	8.901.363.723,20	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,37	4,46	11.174.653,68	3,88	4.251.005.212,54	0,26
BB	BB	BB PREV RF VII	2,28	0,47	2,45	960.253,39	0,33	238.494.074,76	0,40
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,08	0,42	3,69	344.324,64	0,12	570.737.914,69	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,20	-1,77	0,64	154.237.239,52	53,61		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,53	-1,85	0,56	14.933.108,35	5,19	2.909.854.221,69	0,51
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,53	-1,85	0,56	14.933.108,35	5,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,14	1,77	9.619.356,34	3,34	4.687.255.346,64	0,21
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	20.896.794,94	7,26	2.572.617.697,19	0,81
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,40	1,40	824.029,94	0,29	2.028.417.251,32	0,04
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,20	0,18	1,86	31.340.181,22	10,89		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	8,14	-0,22	5,24	1.834.053,00	0,64	184.626.995,14	0,99
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			8,14	-0,22	5,24	1.834.053,00	0,64		
Renda Fixa			12,28	-2,13	-0,83	240.188.905,31	83,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,52%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	43,12	-3,11	-11,75	10.711.310,71	3,72	171.838.205,39	6,23
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	42,73	-3,37	-14,06	5.337.917,95	1,86	115.299.415,24	4,63
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			42,80	-3,20	-12,47	16.049.228,66	5,58		

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 MIDCAPS FIC FI	37,66	-3,07	-24,58	5.656.256,29	1,97	108.988.287,44	5,19
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,93	-3,82	-13,31	7.172.450,31	2,49	819.770.596,51	0,87
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,51	-1,38	-20,21	6.418.567,97	2,23	1.226.260.606,95	0,52
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,95	-0,43	-1,13	4.232.290,48	1,47	157.969.354,10	2,68
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,91	-2,38	-14,09	23.479.565,05	8,16		

Artigo 8º II, Alínea b (Fundos de Índice de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB ACOES ALO ETF	40,65	-2,35	-14,05	2.089.627,18	0,73	175.603.865,00	1,19
Sub-total Artigo 8º II, Alínea b			40,65	-2,35	-14,05	2.089.627,18	0,73		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	1,74	0,02	1,87	470.978,98	0,16	507.987.368,29	0,09
Sub-total Artigo 8º III			1,74	0,02	1,87	470.978,98	0,16		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,47	-0,35	-9,83	360.088,06	0,13	20.489.283,34	1,76
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			159,47	-0,35	-9,83	360.088,06	0,13		
Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CXCE11B	26,03	2,10	-9,92	5.067.500,00	1,76	147.701.406,79	3,43
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			26,03	2,10	-6,99	5.067.500,00	1,76		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			38,85	-2,16	-12,40	47.516.987,93	16,52		
Total						287.705.893,24	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	37.844.323,22	13,15	10,00	30,00	70,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	154.237.239,52	53,61	20,00	30,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	14.933.108,35	5,19	0,00	5,00	30,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	31.340.181,22	10,89	1,00	4,00	30,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.834.053,00	0,64	0,00	1,00	2,00	15,00
	Total Renda Fixa	240.188.905,31	83,48				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	16.049.228,66	5,58	1,00	10,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	23.479.565,05	8,16	2,00	15,00	20,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea b	Fundos de Índice de Ações	2.089.627,18	0,73	0,00	0,00	10,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	470.978,98	0,16	1,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	360.088,06	0,13	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.067.500,00	1,76	1,00	2,00	4,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	47.516.987,93	16,52				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

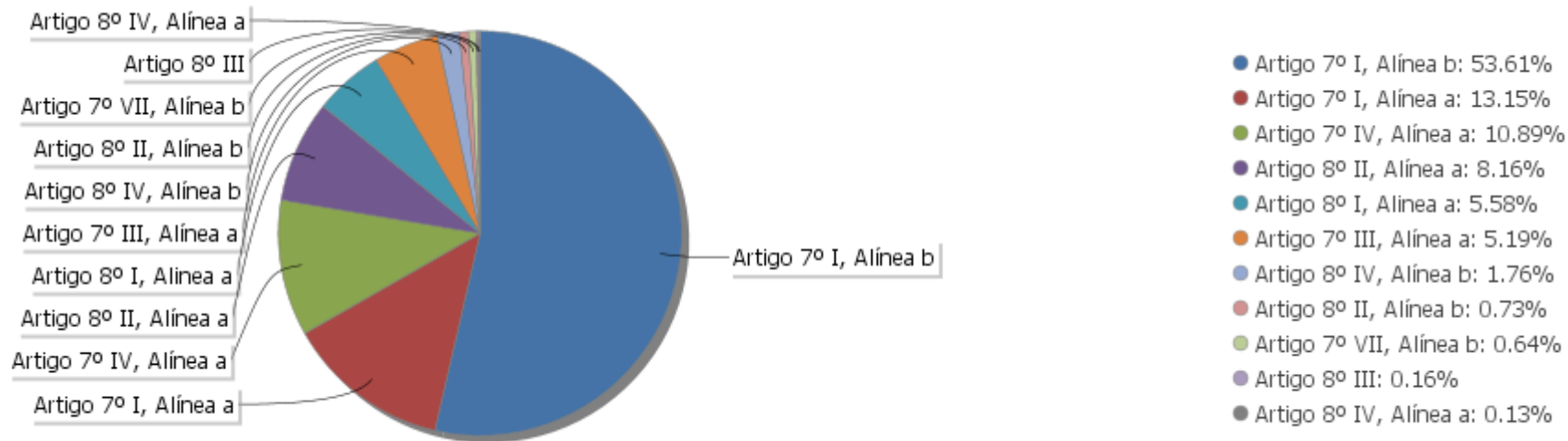
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-5,39 -3.372,11	-6,31 -298,52	7,49 1.318,72	-5,47 -381,41		-2.156.762,33	-2.694.289,08
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,77 -1.107,79	0,64 30,14	4,42 778,10	-0,12 -8,49	6,17 159,90	-2.822.116,02	840.117,10
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,85 -1.157,00	0,56 26,64	4,54 799,81	-0,10 -7,09	6,26 162,08	-281.463,69	83.667,68
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,18 109,68	1,86 87,98	0,69 121,73	1,22 85,36	3,45 89,41	49.616,43	274.408,78
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,22 -135,22	5,24 247,90	2,92 514,31	3,63 253,46	10,47 271,24	-3.974,00	91.377,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,20 0,24	-12,47 1,61	13,89 0,20	-2,96 1,65	-0,40 1,35	-530.262,57	-815.481,37
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,38 1,06	-14,09 -0,01	14,54 0,84	-6,85 -2,24	-2,77 -1,03	-572.352,52	-4.161.383,06
Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,35 1,09	-14,05 0,02	14,94 1,25	-5,50 -0,89		-50.363,83	-341.584,13
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,02 3,47	1,87 15,94	0,19 -13,50	1,28 5,89	4,31 6,06	106,97	8.645,38
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,35 3,09	-9,83 4,24	-1,53 -15,22	-9,04 -4,43	-55,34 -53,59	-1.274,17	-39.262,37
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,10 5,55	-6,99 7,09	4,96 -8,73	1,30 5,91	13,25 15,00	104.701,31	-397.719,59
Artigo 9º A, III % do CDI	0,00 0,00	5,29 249,98	0,00 0,00	4,80 334,87	14,07 364,58	0,00	370.875,59
						-6.264.144,42	-6.780.628,07

Análise de Liquidez

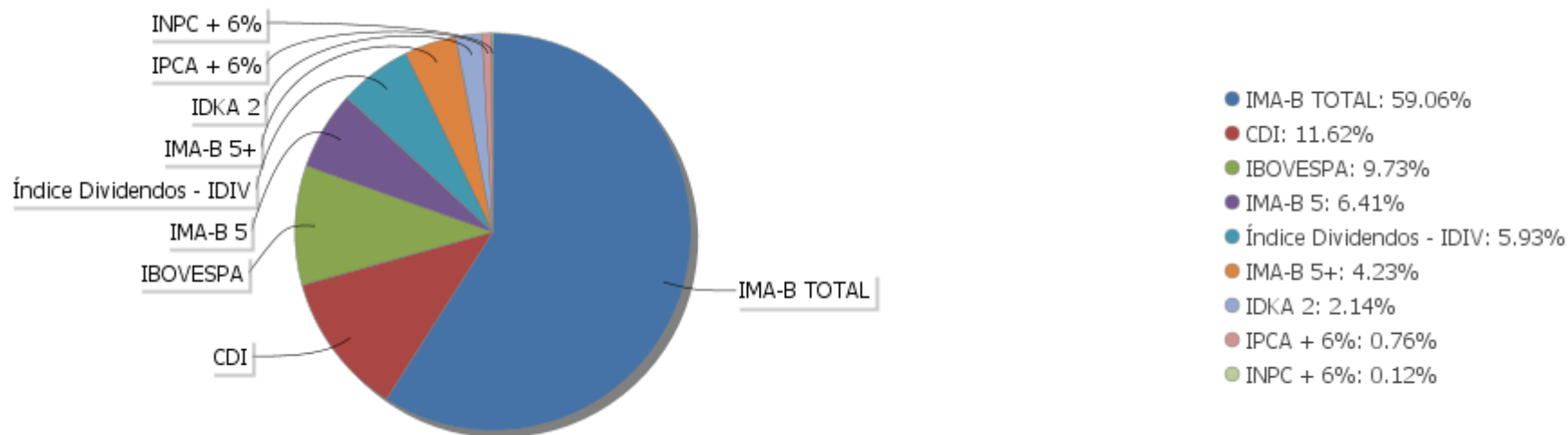
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	236.681.272,22	82,27	236.681.272,22	82,27
de 31 a 364 dias	11.875.719,77	4,13	248.556.991,99	86,39
acima de 365 dias	39.148.901,25	13,61	287.705.893,24	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

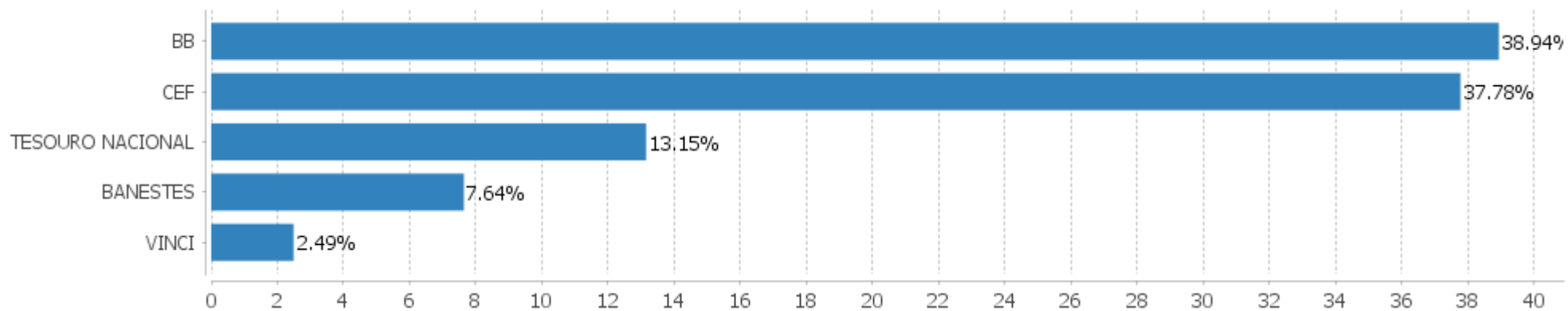


Alocação Por Estratégia



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	-0,14	-1,20	-10,78	2,63	2,05	2,97	5,09	-2,14					-2,38
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72					4,57
p.p. indexador	-0,85	-1,86	-11,35	2,48	1,98	2,24	4,21	-2,85					-6,95
2019	3,19	0,55	0,57	1,43	2,71	3,26	1,07	-0,39	2,70	3,30	-2,30	2,50	20,05
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,36	-0,35	-0,62	0,37	2,07	2,81	0,34	-1,01	2,25	2,67	-3,28	0,86	9,46

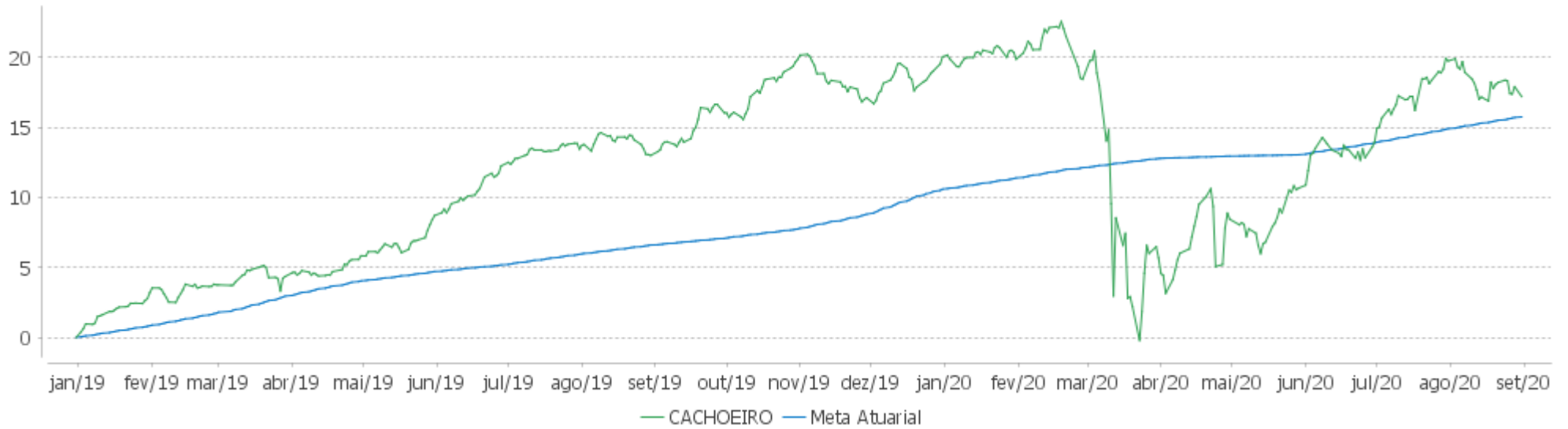
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

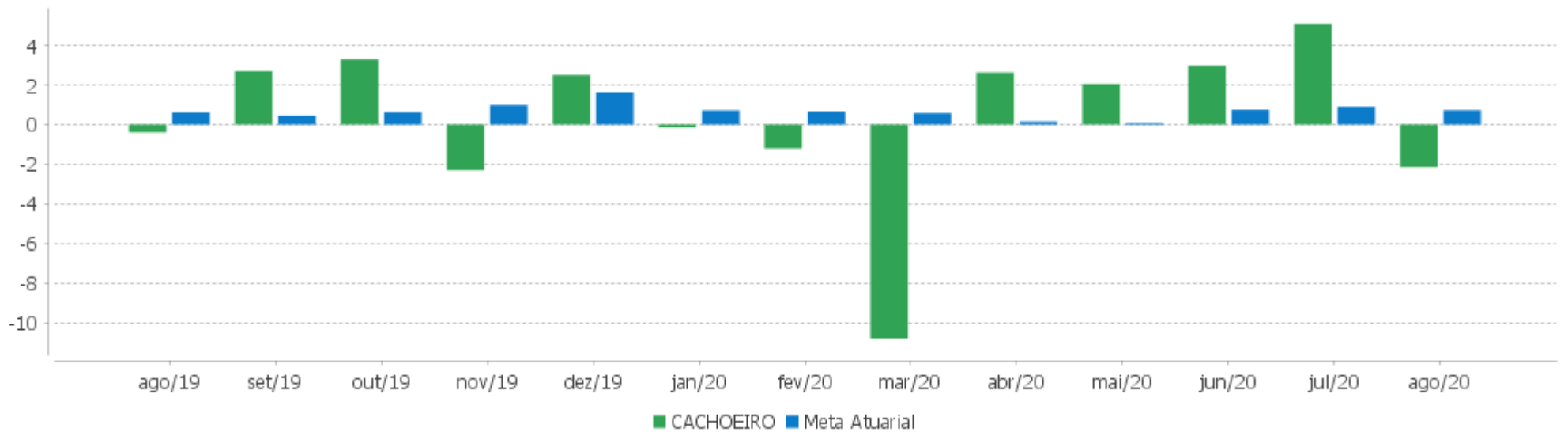
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	60,00	03 meses	5,91	2,35	3,55	8,10
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	40,00	06 meses	-1,05	3,16	-4,20	20,29
			12 meses	3,71	8,49	-4,78	14,88
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,09	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,78	2020-03	Desde 31/12/2018	17,20	15,65	1,55	11,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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
NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-5,39 -3,59	-6,31 -7,12	7,49 2,88	-5,47 -5,56	-0,60 -7,24	42,48 6,48	35,53 -6,67
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	-0,22 -0,94	5,24 0,58	2,92 0,53	3,63 0,41	10,47 1,89	28,20 9,24	34,80 3,48
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,55 -1,75	-5,04 -5,85	6,06 1,45	-5,64 -5,73	2,57 -4,07	40,28 4,29	42,92 0,72
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,03	4,45 -0,18	2,48 -0,07	3,24 -0,15	8,93 -0,32	24,43 -0,58	32,42 -0,91
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,47 2,27	2,45 1,64	1,79 -2,82	1,82 1,73	6,06 -0,59	18,80 -17,19	27,18 -15,03
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,69 -0,35	4,43 -0,96	2,73 -0,26	3,38 -0,74	8,67 -1,03	21,54 -1,98	30,37 -3,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,79 -0,24	4,80 -0,59	2,82 -0,16	3,70 -0,42	8,84 -0,87	21,88 -1,64	30,88 -2,56
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	8,95 -0,29	24,42 -0,59	32,44 -0,89
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	6,38 -0,26	35,28 -0,71	41,12 -1,08
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,42 -0,42	3,69 -1,45	2,25 -0,38	2,69 -1,11	7,87 -1,24	23,87 4,49	41,96 10,87
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,64 -0,02	-2,24 -0,23	6,31 -0,07	-2,48 -0,13	4,26 -0,45	43,30 -1,41	46,76 -1,75
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,69 -0,07	-2,23 -0,22	6,21 -0,16	-2,57 -0,22	4,54 -0,18	43,91 -0,81	47,28 -1,23
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,40 248,06	-0,55 -25,95	1,47 258,86	-1,23 -85,82	0,96 25,00	7,75 74,71	15,70 87,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,18 113,33	1,79 84,85	0,68 119,59	1,16 81,13	3,42 88,51	9,79 94,28	17,31 96,60
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 90,67	1,77 83,59	0,64 112,31	1,12 77,76	3,36 87,05	9,69 93,36	17,02 94,95
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	-1,85	0,56	4,54	-0,10	6,26	35,04	41,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,24	-0,07	-0,19	-0,38	-0,95	-1,07
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,35 -1,08	-9,83 -14,50	-1,53 -3,92	-9,04 -12,26	-74,68 -83,26	-70,80 -89,77	-71,13 -102,46
BB ACOES ALO ETF % do CDI	-2,35 -1.471,90	-14,05 -664,26	14,94 2.632,11	-5,50 -383,61	-0,59 -15,34	30,87 297,42	42,90 239,40
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT Var. IBOVESPA p.p.	0,02 3,47	1,87 15,94	0,19 -13,50	1,28 5,89	4,31 6,06	16,69 -12,90	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,11 0,33	-11,75 2,32	13,86 0,17	-2,20 2,41	-0,42 1,33	29,81 0,22	39,09 -1,19
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-3,37 0,07	-14,06 0,01	13,95 0,26	-4,51 0,10	-1,96 -0,21	28,19 -1,41	37,93 -2,36
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,43 4,40	-1,13 16,12	18,93 8,47	4,33 14,71	10,07 13,71	69,06 24,28	75,12 29,92
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,38 2,06	-15,36 -1,28	21,66 7,96	-7,86 -3,25	3,92 5,67	51,07 21,47	48,05 7,76
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,07 1,76	-18,56 -1,31	11,30 0,85	-11,39 -1,01	-1,94 1,70	29,40 -15,38	24,73 -20,47
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,82 1,01	-13,31 3,94	8,95 -1,51	-8,81 1,57	-1,14 2,51	48,70 3,92	47,11 1,91
CXCE11B Var. IBOVESPA p.p.	1,28 4,72	-9,92 4,16	3,33 -10,36	-1,89 2,72	9,69 11,43	269,16 239,56	1.277,16 1.236,88
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

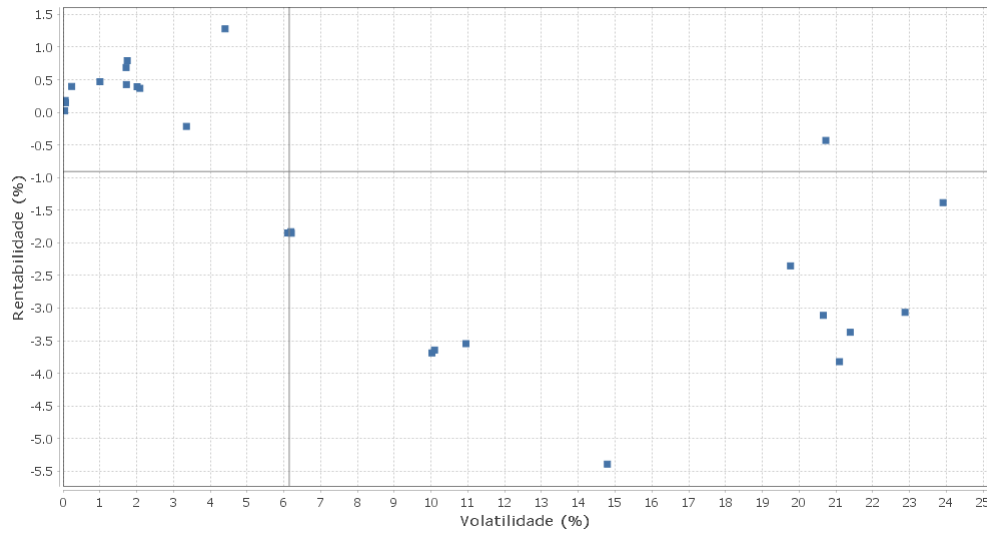
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
122	03/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	420.000,00	183.868,14777600	2,2842455590
123	03/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.760.339,53	0,00	770.643,73533000	2,2842455590
124	03/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.889,06521100	2,2842455590
125	10/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.000,00	0,00	12.251,76827900	2,2853843920
126	10/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.878,15764200	2,2853843920
127	11/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	34.000,00	0,00	9.158,66854500	3,7123300000
128	14/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.871,87	0,00	17.472,69481900	3,7127570000
129	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	13.864,34	6.199,35215200	2,2364175580
130	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	186.717,07	83.489,35972700	2,2364175580
131	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	73.573,15	41.308,49485700	1,7810658620
132	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	1.737.844,53	975.732,88393100	1,7810658620
133	17/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.704,28	0,00	5.119,79058300	2,2860856920
134	18/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.023.000,00	0,00	884.796,40107600	2,2864017050
135	26/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.857,99072000	2,2874929650
136	28/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.821,51	0,00	30.903,03110500	3,7155420000
137	31/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	210.000,00	91.776,30716600	2,2881722580
138	31/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	138.000,00	0,00	60.310,14470900	2,2881722580
139	31/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.754.551,68	0,00	766.791,78058600	2,2881722580
140	31/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.740,60068300	2,2881722580

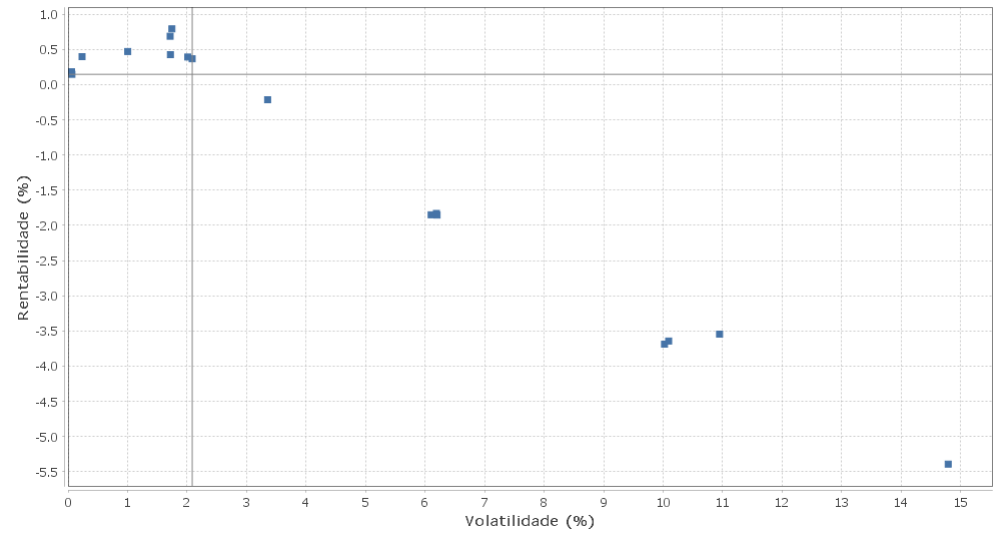
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

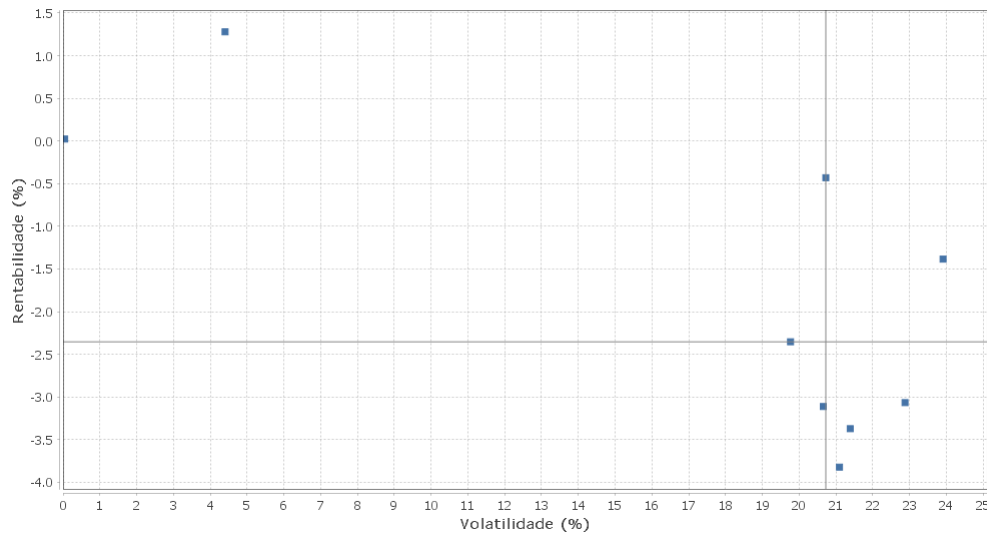
CACHOEIRO - No Mês



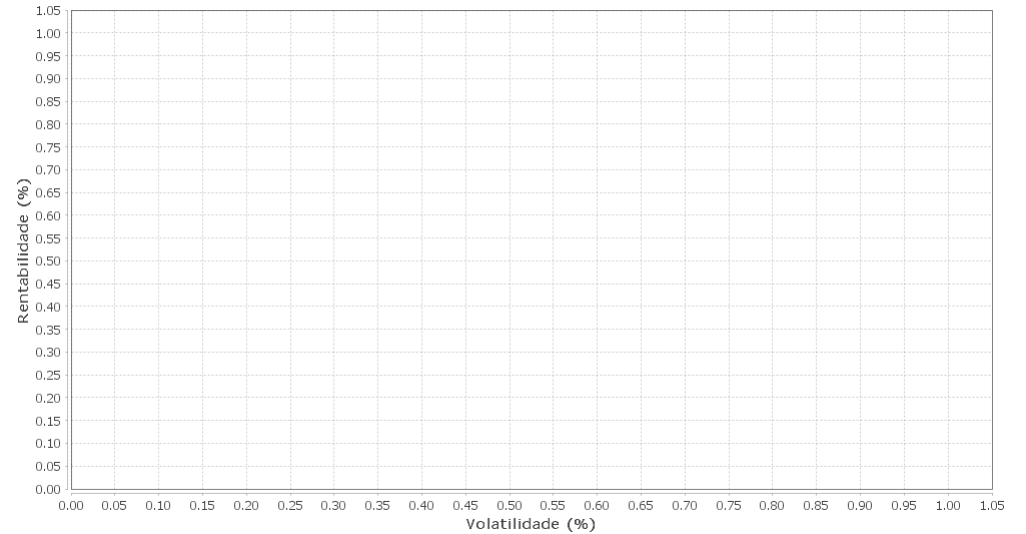
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	Artigo 8º III	0,05	0,01	0,02	470.978,98	0,16
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,01	0,18	20.896.794,94	7,26
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,01	0,14	9.619.356,34	3,34
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,04	0,40	824.029,94	0,29
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,13	0,47	960.253,39	0,33
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,21	0,69	3.530.098,92	1,23
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,20	0,42	344.324,64	0,12
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,22	0,79	2.618.359,36	0,91
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	0,23	0,39	7.270.772,90	2,53
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,09	0,23	0,37	11.174.653,68	3,88
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	3,35	0,34	-0,22	1.834.053,00	0,64
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	4,40	0,52	1,28	5.067.500,00	1,76
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	6,10	0,54	-1,85	14.933.108,35	5,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	0,55	-1,83	48.421.353,21	16,83
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,20	0,55	-1,85	50.826.244,55	17,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,02	0,86	-3,69	5.830.204,18	2,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,09	0,87	-3,64	6.348.804,87	2,21
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	10,95	0,96	-3,55	16.912.169,82	5,88
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	14,79	1,27	-5,39	37.844.323,22	13,15
BB ACOES ALO ETF	Artigo 8º II, Alínea b	19,77	1,93	-2,35	2.089.627,18	0,73
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	20,66	1,99	-3,11	10.711.310,71	3,72
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	20,73	2,13	-0,43	4.232.290,48	1,47
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	2,00	-3,82	7.172.450,31	2,49
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,39	2,05	-3,37	5.337.917,95	1,86
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	22,88	2,22	-3,07	5.656.256,29	1,97
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	23,91	2,41	-1,38	6.418.567,97	2,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de agosto de 2020, observar que;

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III (0,16% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.