



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
JANEIRO 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 27.02.2020.

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 80,18%

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	10,56	-0,86	-0,86	40.995.703,37	14,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		10,56	-0,86	-0,86	40.995.703,37	14,43

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 PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	7,90	0,55	0,55	17.908.424,91	6,30	304.786.097,11	5,88
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,26	0,26	50.635.728,53	17,82	6.477.324.446,92	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,25	0,25	48.278.805,61	16,99	6.604.088.892,56	0,73
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,97	0,54	0,54	10.926.529,00	3,85	9.706.276.068,00	0,11
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,49	0,38	0,38	3.393.496,02	1,19	6.900.045.813,02	0,05
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,27	0,05	0,05	5.966.145,69	2,10	2.287.850.661,28	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,28	-0,04	-0,04	6.491.534,07	2,28	2.270.256.483,13	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,50	0,46	0,46	4.803.106,28	1,69	8.791.015.868,25	0,05
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,56	0,56	14.669.019,79	5,16	4.489.872.848,79	0,33
BB	BB	BB PREV RF VII	1,23	0,20	0,20	2.786.777,10	0,98	692.095.869,22	0,40
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,85	0,42	0,42	541.845,03	0,19	898.056.727,55	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,65	0,35	0,35	166.401.412,03	58,57		

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 NOVO BRASIL IMAB RF LP	4,88	0,23	0,23	14.883.516,23	5,24	3.029.770.455,34	0,49
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,88	0,23	0,23	14.883.516,23	5,24		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,06	0,37	0,37	1.021.607,60	0,36	5.345.385.558,02	0,02
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,35	0,35	2.759.233,15	0,97	2.903.514.199,57	0,10
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,06	0,35	0,35	3.780.840,75	1,33		

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	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CREDITO PRIVAD	3,30	0,81	0,81	1.756.797,00	0,62	185.168.727,54	0,95
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,30	0,81	0,81	1.756.797,00	0,62		
Renda Fixa			3,95	0,14	0,14	227.818.269,38	80,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,03%

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 ACOES IBOV ATIVO FIC	17,98	-1,04	-1,04	7.141.917,15	2,51	129.884.412,49	5,50
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	17,51	-1,71	-1,71	6.104.895,17	2,15	126.776.758,23	4,82
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			17,50	-1,27	-1,27	13.246.812,32	4,66		

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	15,92	-6,22	-6,22	7.033.847,73	2,48	126.891.086,13	5,54
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,73	1,53	1,53	8.400.505,85	2,96	943.947.729,59	0,89
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	16,77	-5,27	-5,27	6.594.580,36	2,32	1.590.900.361,63	0,41
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	16,51	2,03	2,03	4.367.262,88	1,54	132.732.358,95	3,29
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,50	0,06	0,06	26.396.196,82	9,29		

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	16,92	-1,48	-1,48	2.395.167,89	0,84	207.641.569,07	1,15
Sub-total Artigo 8º II, Alínea b			16,92	-1,48	-1,48	2.395.167,89	0,84		

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	1,89	0,32	0,32	463.797,67	0,16	500.501.925,72	0,09
Sub-total Artigo 8º III			1,89	0,32	0,32	463.797,67	0,16		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,49	-0,44	-0,44	397.612,84	0,14	22.795.921,32	1,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			159,49	-0,44	-0,44	397.612,84	0,14		
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	31,21	-2,24	-2,24	5.499.100,00	1,94	144.887.133,77	3,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			31,21	-2,24	-2,24	5.499.100,00	1,94		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,87	-1,06	-1,06	48.398.687,54	17,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,78%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,56	6,52	6,52	7.904.803,84	2,78	797.257.804,89	0,99
Sub-total Artigo 9º A, III			14,56	6,52	6,52	7.904.803,84	2,78		
Investimentos no Exterior			14,56	6,52	6,52	7.904.803,84	2,78		
Total						284.121.760,76	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	40.995.703,37	14,43	10,00	30,00	70,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	166.401.412,03	58,57	20,00	30,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	14.883.516,23	5,24	0,00	5,00	30,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	3.780.840,75	1,33	1,00	4,00	30,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.756.797,00	0,62	0,00	1,00	2,00	5,00
	Total Renda Fixa	227.818.269,38	80,18				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	13.246.812,32	4,66	1,00	10,00	10,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.396.196,82	9,29	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º II, Alínea b	Fundos de Índice de Ações	2.395.167,89	0,84	0,00	0,00	10,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	463.797,67	0,16	1,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	397.612,84	0,14	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.499.100,00	1,94	1,00	2,00	4,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	48.398.687,54	17,03				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	7.904.803,84	2,78	2,00	3,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	7.904.803,84	2,78				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

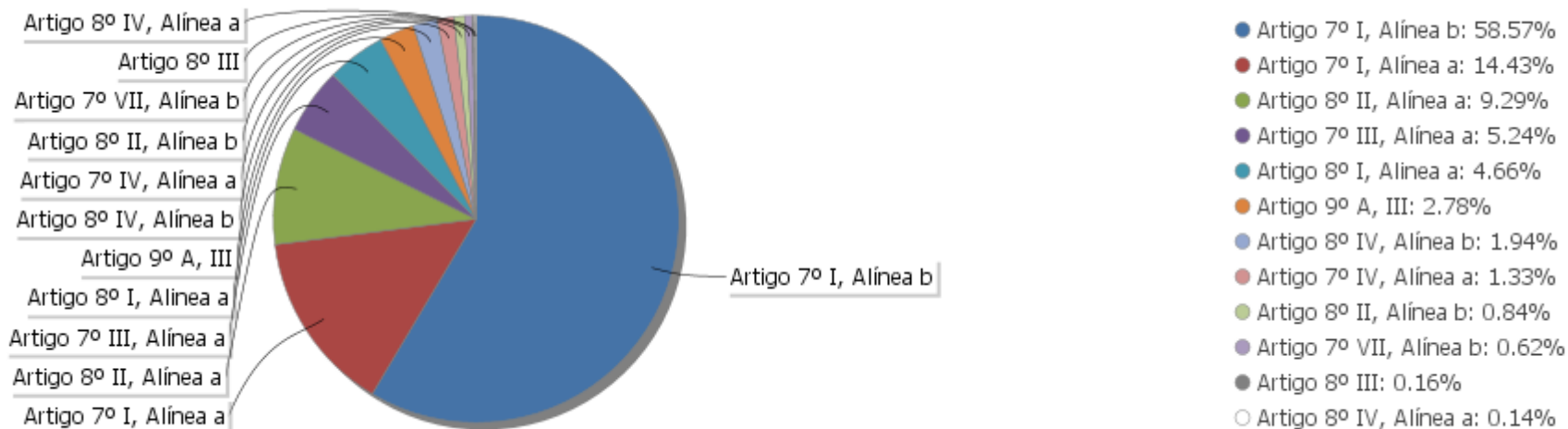
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-0,86 -228,29	-0,86 -228,29	-5,32 -468,33			-355.539,59	-355.539,59
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,35 91,98	0,35 91,98	0,02 1,42	5,36 205,88	16,28 281,48	604.551,78	604.551,78
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,23 60,93	0,23 60,93	-0,36 -31,74	5,45 209,34		34.075,56	34.075,56
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,35 93,53	0,35 93,53	1,03 90,58	2,42 93,08	5,60 96,86	27.772,75	27.772,75
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,81 215,15	0,81 215,15	1,16 101,81	5,80 222,74	15,24 263,48	14.121,00	14.121,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,27 0,36	-1,27 0,36	5,97 -0,13	11,48 -0,25	16,35 -0,45	-429.843,07	-429.843,07
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,06 1,69	0,06 1,69	8,59 2,49	14,70 2,97	26,07 9,26	-620.962,04	-620.962,04
Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,48 0,15	-1,48 0,15	8,43 2,33			-36.043,42	-36.043,42
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,32 1,95	0,32 1,95	1,50 -4,60	3,09 -8,65	7,84 -8,97	1.464,07	1.464,07
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,44 1,19	-0,44 1,19	-1,37 -7,47	-67,38 -79,12	-67,57 -84,37	-1.737,59	-1.737,59
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,24 -0,61	-2,24 -0,61	15,53 9,43	18,11 6,37	22,20 5,39	-126.260,00	-126.260,00
Artigo 9º A, III % do CDI	6,52 1.730,84	6,52 1.730,84	13,98 1.230,63	22,36 858,57	42,28 730,99	483.759,67	483.759,67
						-404.640,88	-404.640,88

Análise de Liquidez

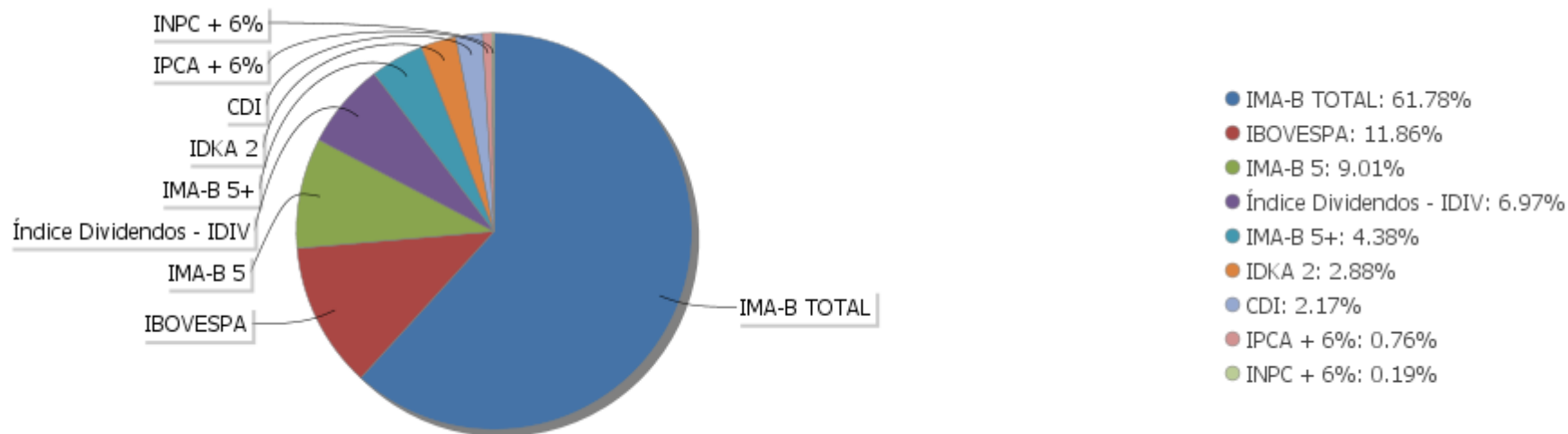
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	226.565.868,86	79,74	226.565.868,86	79,74
de 31 a 364 dias	13.231.566,40	4,66	239.797.435,26	84,40
acima de 365 dias	44.324.325,50	15,60	284.121.760,76	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

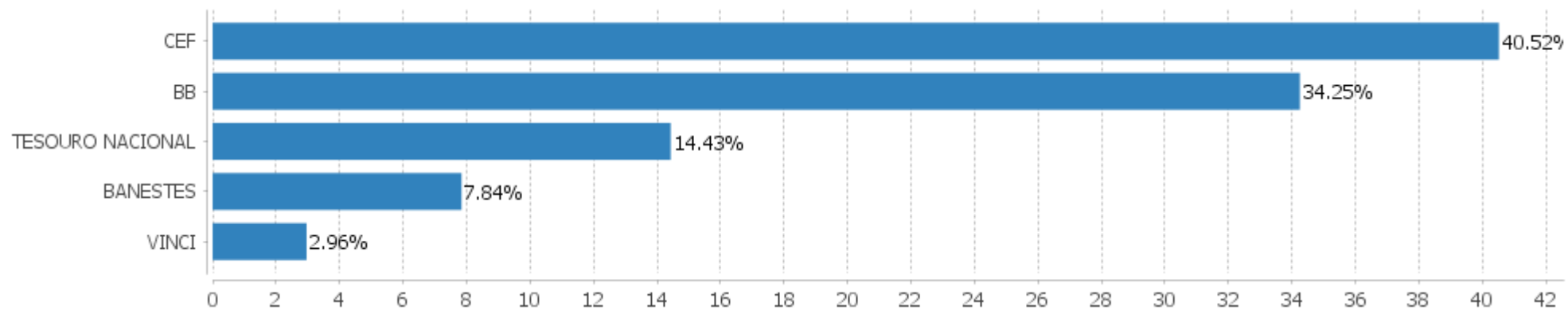


Alocação Por Estratégia



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												-0,14
IPCA + 5,86%	0,71												0,71
p.p. indexador	-0,85												-0,85
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

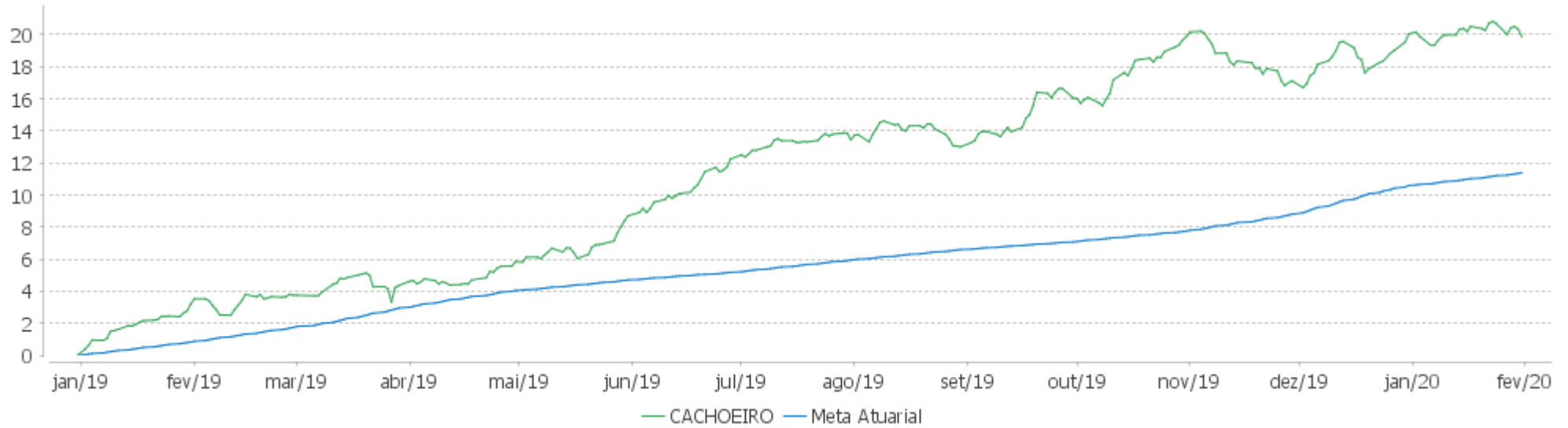
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

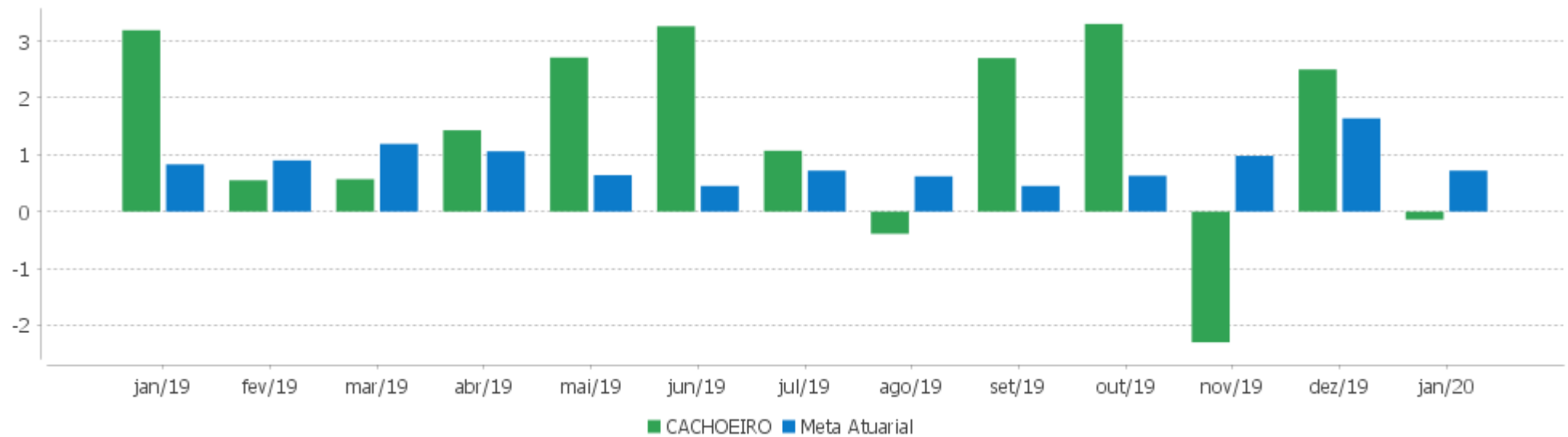
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	8	61,54	03 meses	-0,00	3,36	-3,36	4,66
Meses abaixo da Meta Atuarial	5	38,46	06 meses	5,67	5,13	0,54	4,48
			12 meses	16,17	10,46	5,72	4,09
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,30	2019-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-2,30	2019-11	Desde 31/12/2018	19,88	11,37	8,50	3,99

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
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,35 92,89	0,35 92,89	1,05 92,35	2,45 94,13	5,55 95,98	12,19 97,29	22,86 99,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,37 98,46	0,37 98,46	1,03 91,06	2,44 93,73	5,55 95,93	12,08 96,40	22,61 97,91
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CREDITO PRIVAD Var. IPCA + 6% p.p.	0,81 0,09	0,81 0,09	1,16 -2,22	5,80 0,66	15,24 4,77	25,27 3,81	37,15 4,81
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23 -0,03	0,23 -0,03	-0,36 -0,12	5,45 -0,19	17,66 -0,45	34,19 -0,59	52,87 -1,45
NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,86 -1,12	-0,86 -1,12	-4,78 -4,54	3,90 -1,74	20,94 2,82	38,81 4,02	52,73 -1,59
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,36 -0,12	5,44 -0,20	17,72 -0,40	34,14 -0,64	53,25 -1,07
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,29	0,55 0,29	-1,35 -1,11	6,31 0,67	25,06 6,94	42,79 8,00	64,13 9,81
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,01	0,54 -0,01	1,41 -0,10	4,89 -0,15	11,76 -0,30	22,83 -0,53	38,27 -0,85
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,06	0,20 -0,06	1,55 1,79	3,91 -1,73	9,21 -8,90	20,11 -14,67	34,75 -19,57
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,38 -0,15	0,38 -0,15	1,75 -0,01	4,52 -0,22	10,29 -0,73	20,76 -1,68	35,58 -3,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,46 -0,08	0,46 -0,08	1,57 -0,19	4,44 -0,31	10,30 -0,72	20,93 -1,51	35,71 -2,96
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,56 -0,00	0,56 -0,00	1,44 -0,07	4,92 -0,12	11,82 -0,24	22,86 -0,50	38,36 -0,77
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 -0,00	0,26 -0,00	-0,30 -0,06	5,54 -0,10	17,83 -0,29	34,11 -0,67	53,19 -1,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,42 -0,28	0,42 -0,28	1,47 -1,98	4,59 -0,57	11,28 0,69	32,08 10,73	44,58 13,63
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04 -0,07	-0,04 -0,07	-1,75 -0,21	5,77 -0,31	21,74 -0,59	42,13 -1,28	64,08 -1,90
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,05 0,01	0,05 0,01	-1,45 0,09	6,13 0,06	22,08 -0,25	42,79 -0,62	64,47 -1,51
BB ACOES IBOV ATIVO FIC	-1,04	-1,04	5,90	11,71	15,83	32,44	65,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,59	0,59	-0,20	-0,02	-0,97	-1,53	-10,17
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-1,71 -0,08	-1,71 -0,08	5,96 -0,14	11,27 -0,47	16,13 -0,68	32,41 -1,56	72,38 -3,52
CXCE11B Var. IBOVESPA p.p.	-2,24 -0,61	-2,24 -0,61	13,98 7,88	18,11 6,37	22,20 5,39	25,51 -8,47	
BB ACOES ALO ETF % do CDI	-1,48 -393,64	-1,48 -393,64	8,43 741,85	13,46 516,88	18,64 322,17	37,63 300,24	81,89 354,70
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,44 -1,16	-0,44 -1,16	-1,37 -4,74	-67,38 -72,53	-67,57 -78,03	-68,00 -89,46	-62,92 -95,26
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT Var. IBOVESPA p.p.	0,32 1,95	0,32 1,95	1,50 -4,60	3,09 -8,65	7,26 -9,54		
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,03 3,61	2,03 3,61	9,61 -1,18	15,76 -1,39	31,93 4,92	59,36 8,60	105,60 14,45
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	0,50 2,13	0,50 2,13	18,51 12,41	24,23 12,50	41,26 24,46	56,18 22,21	119,71 43,80
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,28 2,86	1,28 2,86	16,53 5,74	23,42 6,27	38,66 11,66	46,46 -4,30	80,11 -11,03
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,53 3,11	1,53 3,11	10,76 -0,03	17,94 0,79	28,52 1,51	51,11 0,35	95,52 4,37
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,52 8,15	6,52 8,15	13,98 7,88	22,36 10,62	42,28 25,48	55,39 21,41	99,23 23,32
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32
IMA-C TOTAL	2,54	2,54	1,76	6,14	20,05	38,88	56,63
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	0,50	0,70	4,08	11,07	22,22	37,86
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
Renda Variável							
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06
Índice Consumo - ICON			15,32	21,23	43,29	43,57	87,57
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,82	15,10	14,63
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64
IPCA + 5,5%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33
INPC + 4%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

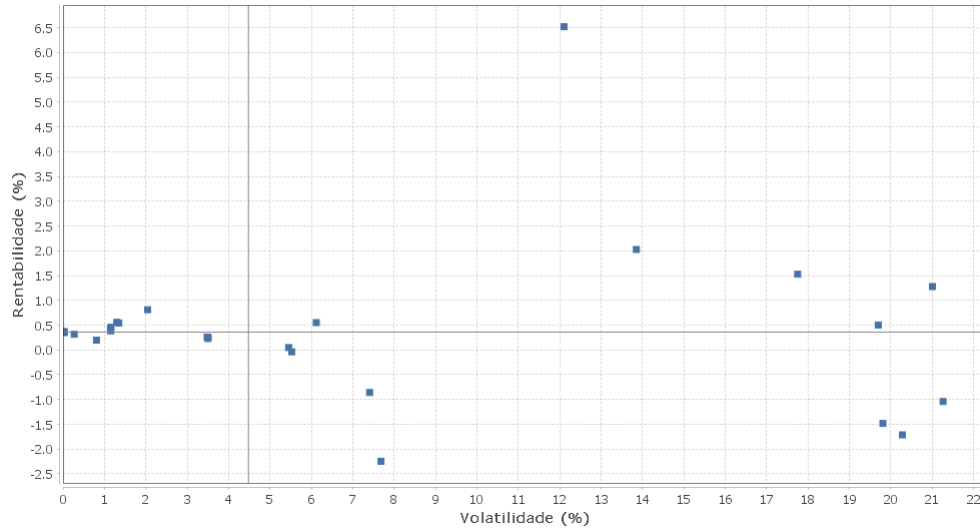
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
06/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.000,00	0,00	9.782,38294500	2,2489407870
09/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	49.000,00	0,00	13.405,87828600	3,6551130000
10/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	116.000,00	0,00	31.731,19085700	3,6557090000
15/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.564.000,00	0,00	694.638,63550800	2,2515303930
16/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	41.000,00	0,00	11.207,78049500	3,6581730000
16/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	22.000,00	9.769,49549000	2,2519074830
20/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	23.696,30	10.519,36301500	2,2526363970
20/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.962.686,12	3.090.905,44797300	2,2526363997
21/01/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.752.700,62	0,00	3.167.163,88607000	2,1320970000
22/01/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	209.985,50	0,00	97.762,70886500	2,1479100000
22/01/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,00	11.500.000,00	5.159.136,94960900	2,2290549974
22/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	114.000,00	0,00	50.591,12087900	2,2533598390
22/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.500.000,00	0,00	3.328.363,21576000	2,2533598390
23/01/2020	FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	4.000.000,00	0,00	1.606.125,76366200	2,4904650000
23/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.874,92279800	2,2535407300
23/01/2020	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	4.000.000,00	207.716,79344300	19,2569889690
23/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.500.000,00	3.328.096,04022500	2,2535407360
23/01/2020	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	7.500.000,00	0,00	2.937.107,45835300	2,5535327210
24/01/2020	BB ACOES IBOV ATIVO FIC	4.000.000,00	0,00	448.530,24695300	8,9180161810
29/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.607,60746300	2,2549941810
29/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.200.000,00	975.612,27365300	2,2549941810
30/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.578.511,58	0,00	699.898,44528100	2,2553437440

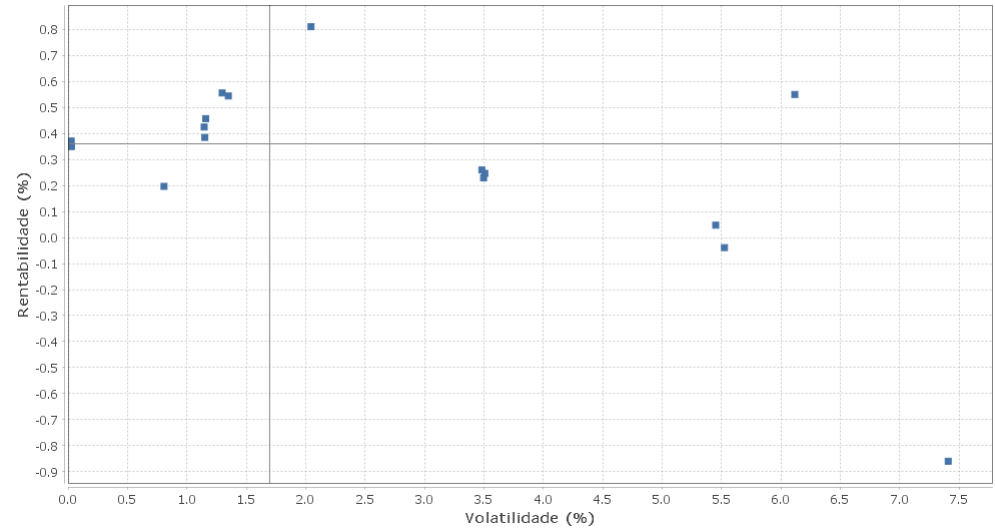
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

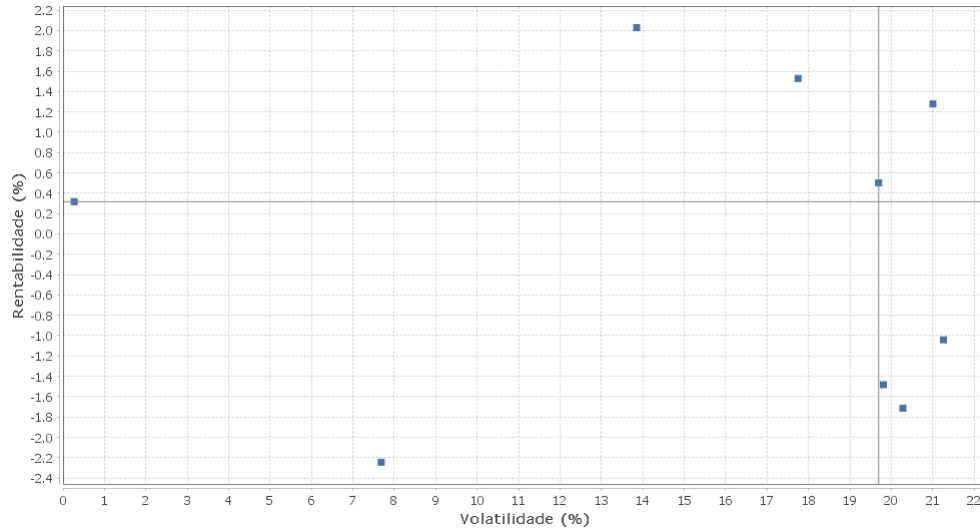
CACHOEIRO - No Mês



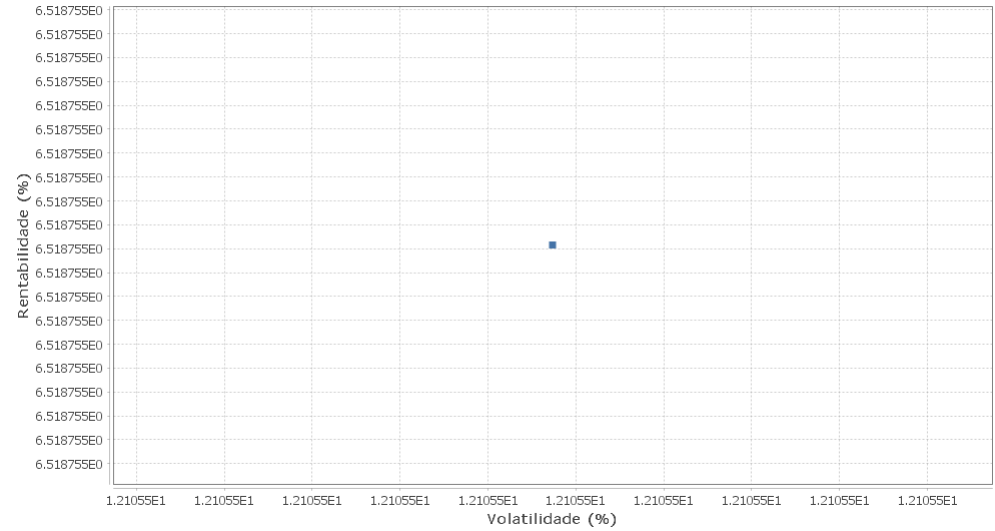
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,37	1.021.607,60	0,36
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	2.759.233,15	0,97
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	Artigo 8º III	0,27	0,04	0,32	463.797,67	0,16
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,81	0,09	0,20	2.786.777,10	0,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,15	0,14	0,42	541.845,03	0,19
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,15	0,14	0,38	3.393.496,02	1,19
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,16	0,14	0,46	4.803.106,28	1,69
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,56	14.669.019,79	5,16
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,54	10.926.529,00	3,85
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CREDITO PRIVAD	Artigo 7º VII, Alínea b	2,05	0,25	0,81	1.756.797,00	0,62
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	0,37	0,26	50.635.728,53	17,82
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	3,50	0,37	0,23	14.883.516,23	5,24
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	0,37	0,25	48.278.805,61	16,99
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	5,45	0,57	0,05	5.966.145,69	2,10
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,53	0,57	-0,04	6.491.534,07	2,28
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	6,12	0,66	0,55	17.908.424,91	6,30
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	7,41	0,73	-0,86	40.995.703,37	14,43
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	7,68	0,69	-2,24	5.499.100,00	1,94
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	12,11	1,54	6,52	7.904.803,84	2,78
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	13,85	1,53	2,03	4.367.262,88	1,54
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	17,75	1,91	1,53	8.400.505,85	2,96
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	19,70	2,06	0,50	6.594.580,36	2,32
BB ACOES ALO ETF	Artigo 8º II, Alínea b	19,81	1,98	-1,48	2.395.167,89	0,84
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	20,28	2,02	-1,71	6.104.895,17	2,15
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	21,00	2,23	1,28	7.033.847,73	2,48
BB ACOES IBOV ATIVO FIC	Artigo 8º I, Alínea a	21,26	2,16	-1,04	7.141.917,15	2,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de janeiro 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.