



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
JULHO 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 18.08.2020.

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 83,29%

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	25,36	9,70	-0,98	40.001.085,55	13,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		25,36	9,70	-0,98	40.001.085,55	13,75

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	22,79	7,49	-1,55	17.533.887,98	6,03	336.367.162,90	5,21
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,47	4,36	2,54	51.786.181,76	17,80	5.823.784.558,48	0,89
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,54	4,38	2,42	49.324.177,69	16,96	6.313.416.954,01	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,97	4,05	7.242.397,14	2,49	12.027.903.790,65	0,06
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,11	0,81	3,71	3.506.043,11	1,21	6.099.396.938,17	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,21	7,28	1,51	6.053.467,25	2,08	2.088.485.812,29	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,32	7,29	1,46	6.588.858,05	2,27	2.059.270.796,72	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,02	0,83	3,97	2.597.796,76	0,89	7.954.778.997,85	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,97	4,08	11.133.822,13	3,83	4.153.926.563,49	0,27
BB	BB	BB PREV RF VII	2,29	0,32	1,97	2.761.736,12	0,95	685.876.947,75	0,40
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,08	0,72	3,25	542.986,64	0,19	899.948.386,83	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,14	4,30	2,45	159.071.354,63	54,68		

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	12,47	4,40	2,46	15.214.572,04	5,23	2.998.036.270,63	0,51
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,47	4,40	2,46	15.214.572,04	5,23		

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	0,25	1,62	9.391.955,89	3,23	4.665.137.027,34	0,20
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,24	1,61	15.948.545,52	5,48	2.412.408.451,26	0,66
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,61	1,00	820.774,51	0,28	1.958.639.802,94	0,04
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,20	0,25	1,68	26.161.275,92	8,99		

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	8,13	1,86	5,47	1.838.027,00	0,63	184.385.326,60	1,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			8,13	1,86	5,47	1.838.027,00	0,63		

Renda Fixa			12,18	4,70	1,33	242.286.315,14	83,29		
-------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,71%

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	43,21	8,11	-8,92	11.055.345,35	3,80	179.180.659,43	6,17
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	42,71	8,08	-11,06	5.524.145,88	1,90	118.687.515,39	4,65
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			42,80	8,10	-9,58	16.579.491,23	5,70		

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	37,55	6,92	-22,20	5.835.119,25	2,01	103.005.237,28	5,66
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,01	8,32	-9,87	7.457.472,78	2,56	862.156.434,48	0,86
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,49	9,27	-19,09	6.508.712,90	2,24	1.227.996.315,01	0,53
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,00	8,36	-0,70	4.250.612,64	1,46	154.315.606,33	2,75
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,95	8,24	-11,99	24.051.917,57	8,27		

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	40,75	7,68	-11,98	2.139.991,01	0,74	184.433.770,90	1,16
Sub-total Artigo 8º II, Alínea b			40,75	7,68	-11,98	2.139.991,01	0,74		

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	1,76	0,05	1,85	470.872,01	0,16	507.871.987,12	0,09
Sub-total Artigo 8º III			1,76	0,05	1,85	470.872,01	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	159,94	-0,69	-9,51	361.362,23	0,12	20.489.283,34	1,76
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			159,94	-0,69	-9,51	361.362,23	0,12		
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	30,30	-0,41	-11,05	5.003.500,00	1,72	147.701.406,79	3,39
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			30,30	-0,41	-8,90	5.003.500,00	1,72		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,13	7,05	-10,46	48.607.134,05	16,71		
Total						290.893.449,19	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	40.001.085,55	13,75	10,00	30,00	70,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	159.071.354,63	54,68	20,00	30,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	15.214.572,04	5,23	0,00	5,00	30,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	26.161.275,92	8,99	1,00	4,00	30,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.838.027,00	0,63	0,00	1,00	2,00	15,00
	Total Renda Fixa	242.286.315,14	83,29				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	16.579.491,23	5,70	1,00	10,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	24.051.917,57	8,27	2,00	15,00	20,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea b	Fundos de Índice de Ações	2.139.991,01	0,74	0,00	0,00	10,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	470.872,01	0,16	1,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	361.362,23	0,12	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.003.500,00	1,72	1,00	2,00	4,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	48.607.134,05	16,71				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

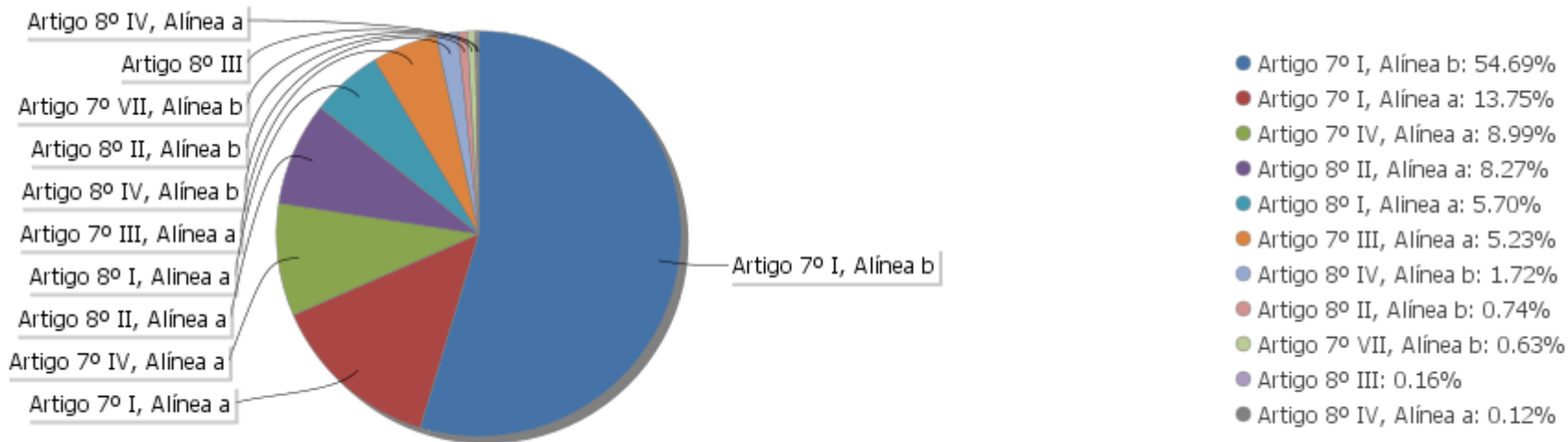
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	9,70 4.988,71	-0,98 -49,95	13,78 2.140,37	-0,12 -7,40		3.535.355,64	-537.526,75
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	4,30 2.210,39	2,45 125,61	7,89 1.225,58	2,10 133,69	7,57 179,67	6.551.719,54	3.662.233,12
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	4,40 2.262,18	2,46 125,96	8,09 1.256,98	2,22 141,71	7,80 185,00	640.710,31	365.131,37
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,25 130,05	1,68 86,20	0,82 127,70	1,33 84,47	3,78 89,73	64.579,29	224.792,35
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,86 954,94	5,47 280,29	6,05 939,30	4,62 294,58	10,69 253,70	33.489,00	95.351,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,10 -0,16	-9,58 1,43	27,13 -0,70	-8,41 1,12	2,10 1,02	1.242.707,42	-285.218,80
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,24 -0,03	-11,99 -0,98	25,27 -2,56	-12,04 -2,51	0,89 -0,19	1.830.658,79	-3.589.030,54
Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	7,68 -0,59	-11,98 -0,97	25,77 -2,07	-10,65 -1,12		152.615,06	-291.220,30
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,05 -8,21	1,85 12,86	0,43 -27,40	1,53 11,06	4,66 3,58	257,64	8.538,41
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,69 -8,96	-9,51 1,50	-7,78 -35,61	-9,12 0,42	-70,36 -71,44	-2.526,94	-37.988,20
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,41 -8,68	-8,90 2,11	7,22 -20,61	-6,81 2,72	10,06 8,98	-20.330,87	-502.420,90
Artigo 9º A, III % do CDI	0,00 0,00	5,29 270,86	0,00 0,00	-1,16 -73,64	20,94 496,94	0,00	370.875,59
						14.029.234,88	-516.483,65

Análise de Liquidez

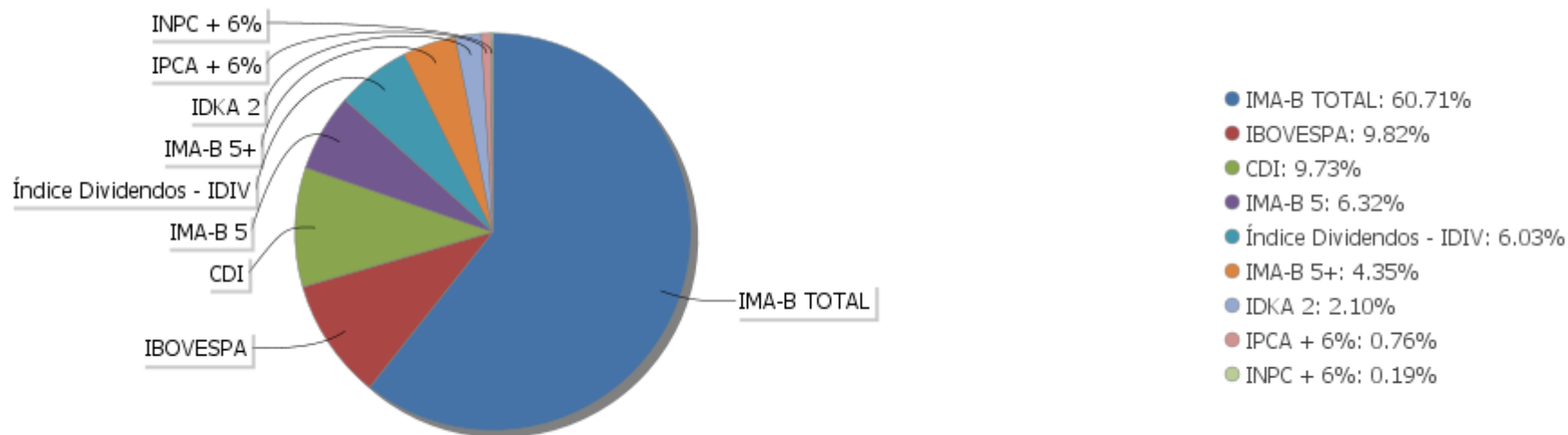
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	235.408.683,45	80,93	235.408.683,45	80,93
de 31 a 364 dias	12.178.957,43	4,19	247.587.640,88	85,11
acima de 365 dias	43.305.808,31	14,89	290.893.449,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

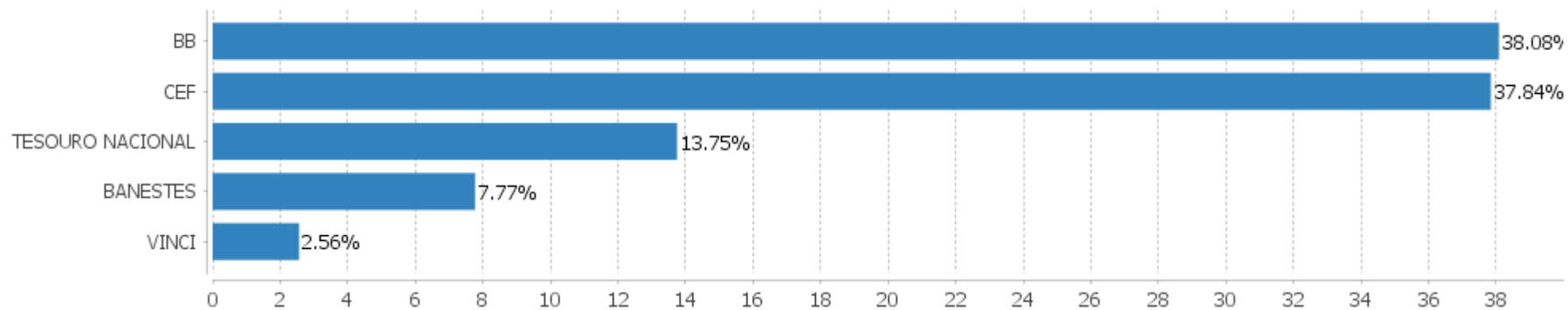


Alocação Por Estratégia



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						-0,25
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88						3,83
p.p. indexador	-0,85	-1,86	-11,35	2,48	1,98	2,24	4,21						-4,08
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

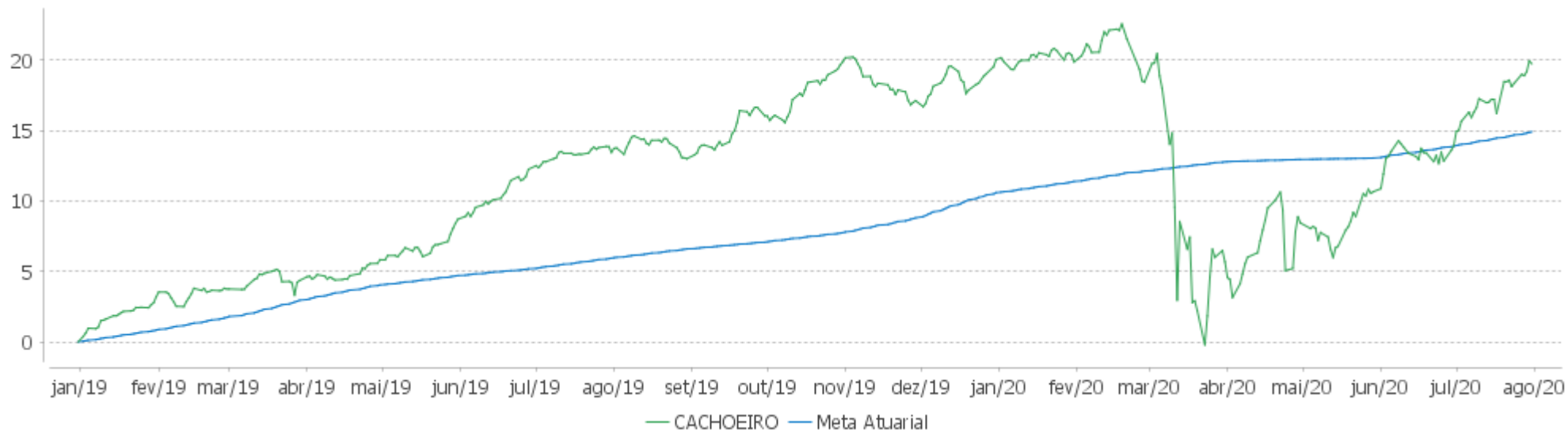
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

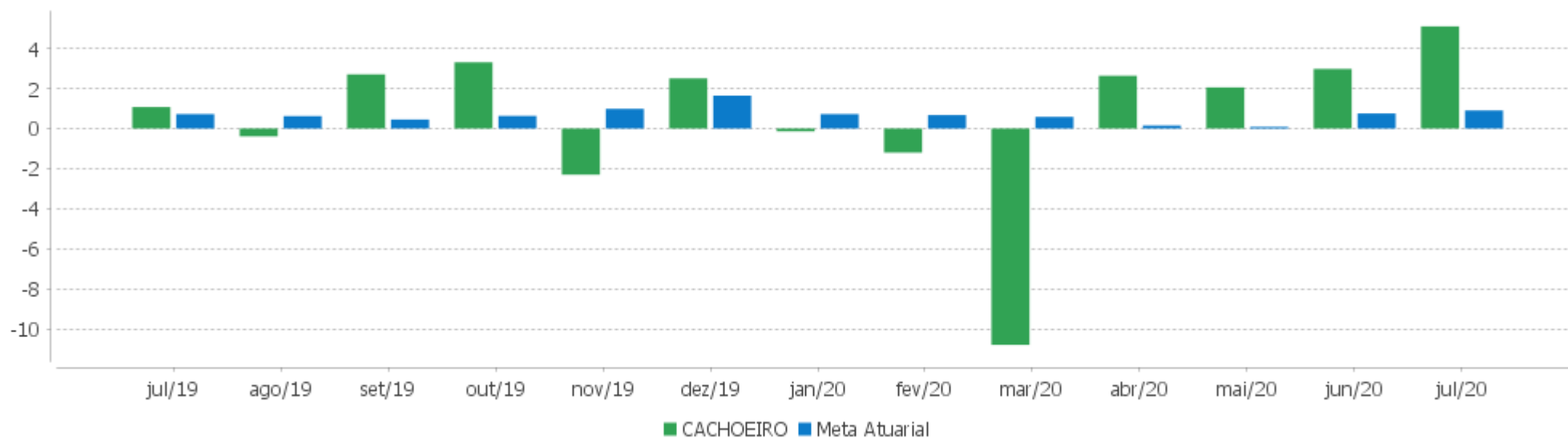
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	63,16	03 meses	10,43	1,70	8,73	8,45
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	36,84	06 meses	-0,11	3,10	-3,20	20,59
			12 meses	5,56	8,39	-2,83	14,74
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,09	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,78	2020-03	Desde 31/12/2018	19,75	14,82	4,93	11,93

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
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	1,86 0,96	5,47 1,56	6,05 4,31	4,62 1,46	10,69 2,22	28,48 9,86	35,88 4,56
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,49 3,11	-1,55 -4,20	10,74 2,60	-2,09 -4,47	4,08 -4,07	44,21 6,35	49,90 3,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,38 -0,01	2,42 -0,23	8,09 -0,05	2,17 -0,22	7,72 -0,43	37,07 -0,79	45,56 -1,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,05 -0,15	4,23 -0,05	3,48 -0,13	8,54 -0,29	23,61 -0,55	33,54 -0,89
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,32 -4,07	1,97 -0,68	2,58 -5,56	1,77 -0,61	5,74 -2,41	18,19 -19,68	27,84 -18,91
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,81 -0,13	3,71 -0,60	4,07 0,35	3,32 -0,44	7,99 -0,69	20,62 -1,75	30,76 -2,60
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,83 -0,11	3,97 -0,34	3,96 0,24	3,50 -0,26	8,10 -0,58	20,93 -1,44	31,10 -2,25
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,08 -0,11	4,20 -0,08	3,51 -0,11	8,59 -0,24	23,64 -0,51	33,60 -0,83
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,36 -0,02	2,54 -0,11	8,07 -0,07	2,27 -0,11	7,94 -0,22	37,20 -0,66	45,69 -1,07
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,72 -0,25	3,25 -1,01	3,69 1,70	2,82 -0,72	7,54 -1,34	23,01 4,01	42,72 12,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,29 -0,03	1,46 -0,22	11,43 -0,08	1,50 -0,14	7,35 -0,46	47,92 -1,45	54,33 -1,86
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	7,28 -0,05	1,51 -0,16	11,38 -0,12	1,46 -0,18	7,68 -0,13	48,58 -0,79	54,96 -1,23
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,40 0,01	2,46 -0,19	8,09 -0,05	2,22 -0,16	7,80 -0,36	36,97 -0,90	45,75 -1,00
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,61 314,02	-0,94 -48,24	1,32 205,51	-1,33 -84,82	1,09 25,76	7,99 73,79	16,22 86,85
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 121,46	1,61 82,50	0,75 117,07	1,26 80,04	3,74 88,70	10,19 94,14	18,03 96,53
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,25 127,85	1,62 83,02	0,82 127,63	1,25 79,33	3,72 88,18	10,14 93,65	17,77 95,15
NTN-B 150555	9,70	-0,98	13,78	-0,12	3,78	49,17	44,82

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.	5,31	-3,62	5,64	-2,50	-4,37	11,31	-1,94
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	8,11	-8,92	27,10	-7,96	2,82	29,24	53,90
Var. IBOVESPA p.p.	-0,15	2,09	-0,73	1,58	1,74	-0,67	-2,22
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	8,08	-11,06	27,18	-9,51	0,68	28,59	53,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	-0,05	-0,65	0,02	-0,40	-1,32	-2,94
BB ACOES ALO ETF	7,68	-11,98	25,77	-10,65	1,37	31,62	56,80
% do CDI	3.951,46	-613,61	4.001,77	-678,76	32,57	291,98	304,15
CXCE11B	-1,16	-11,05	5,51	-9,01	7,46	288,31	1.186,78
Var. IBOVESPA p.p.	-9,43	-0,04	-22,32	0,52	6,38	258,40	1.130,66
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	-0,69	-9,51	-7,78	-9,12	-70,36	-70,74	-71,07
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,59	-13,42	-9,51	-12,28	-78,83	-89,37	-102,39
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	0,05	1,85	0,43	1,53	4,66		
Var. IBOVESPA p.p.	-8,21	12,86	-27,40	11,06	3,58		
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	8,36	-0,70	27,26	-2,67	12,67	62,04	86,72
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,83	12,35	5,40	8,98	9,17	15,55	23,54
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9,27	-14,17	29,24	-14,60	6,10	47,15	63,31
Var. IBOVESPA p.p.	1,01	-3,16	1,41	-5,06	5,02	17,25	7,19
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	6,92	-15,98	21,26	-17,04	2,39	31,74	35,50
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,39	-2,93	-0,60	-5,39	-1,11	-14,75	-27,68
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,32	-9,87	21,78	-11,23	4,70	50,50	62,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,79	3,18	-0,08	0,43	1,20	4,00	-0,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
Renda Variável							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
Meta Atuarial							

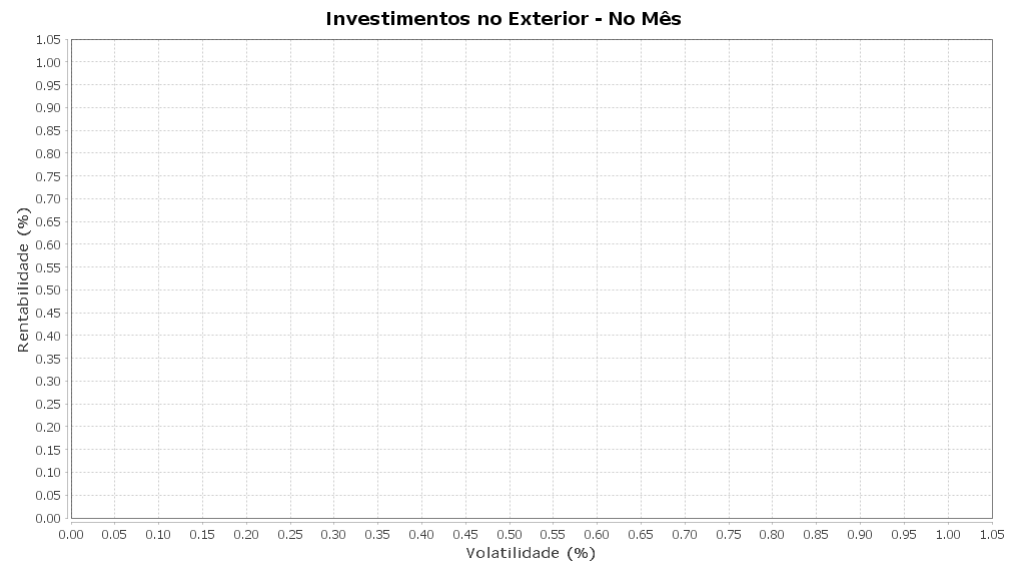
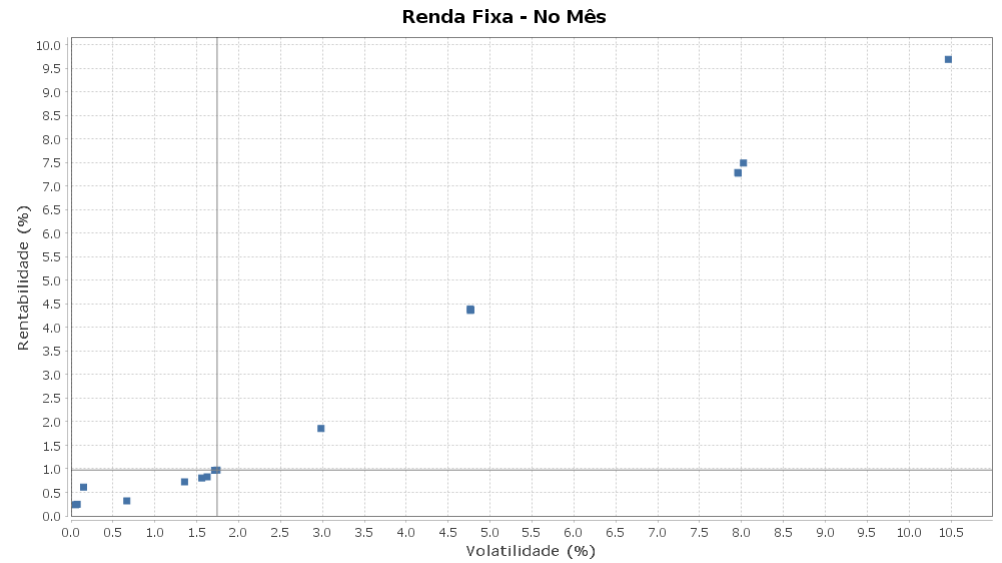
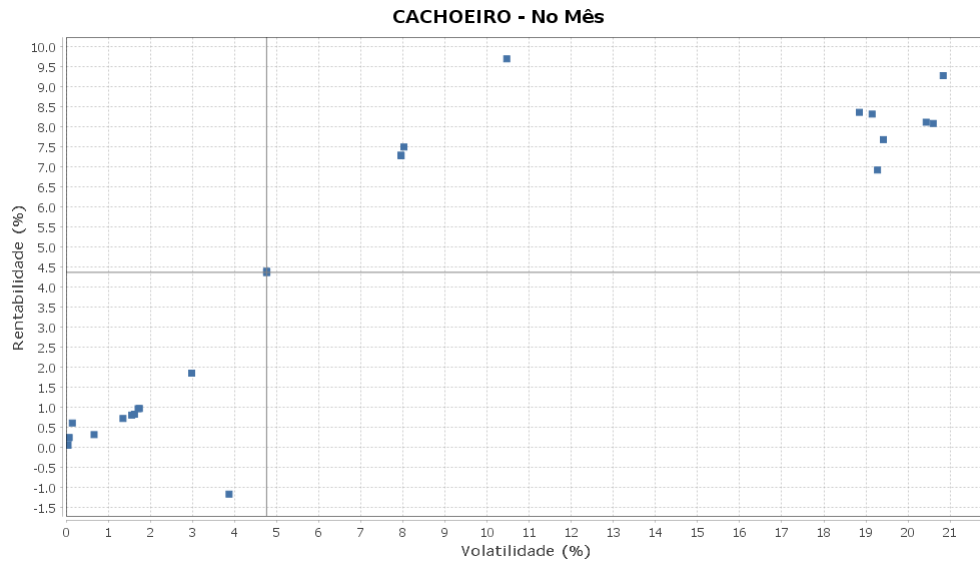
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
107	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	95.000,00	25.664,64674400	3,7015900000
108	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	172.232,26	0,00	46.529,26445100	3,7015900000
109	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.159,52760900	2,2797170910
110	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.612.336,03	0,00	1.145.903,60370200	2,2797170910
111	09/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	170.000,00	0,00	74.554,22848100	2,2802194250
112	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	449.000,00	0,00	196.755,94572200	2,2820149010
113	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.764,18466500	2,2820149010
114	21/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	139.000,00	0,00	37.498,29706400	3,7068350000
115	22/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.200.000,00	0,00	963.911,68541200	2,2823667700
116	27/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.350.000,00	1.029.237,01784400	2,2832447330
117	27/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.898,65995400	2,2832447330
118	28/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.114,28	0,00	9.684,61640600	2,2834440800
119	30/07/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.821,51	0,00	30.951,69690200	3,7097000000
120	31/07/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	820.773,91	481.138,93768512	1,7058979167
121	31/07/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	820.774,51	0,00	481.139,28856174	1,7058979167

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



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	0,05	470.872,01	0,16
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,24	15.948.545,52	5,48
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,25	9.391.955,89	3,23
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,15	0,04	0,61	820.774,51	0,28
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,67	0,08	0,32	2.761.736,12	0,95
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,17	0,72	542.986,64	0,19
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,56	0,20	0,81	3.506.043,11	1,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,62	0,20	0,83	2.597.796,76	0,89
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	0,22	0,97	11.133.822,13	3,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	0,22	0,97	7.242.397,14	2,49
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	2,98	0,39	1,86	1.838.027,00	0,63
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	3,87	0,35	-1,16	5.003.500,00	1,72
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,76	0,68	4,36	51.786.181,76	17,80
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,76	0,68	4,40	15.214.572,04	5,23
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	0,68	4,38	49.324.177,69	16,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,95	1,13	7,29	6.588.858,05	2,27
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,96	1,13	7,28	6.053.467,25	2,08
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	8,02	1,15	7,49	17.533.887,98	6,03
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	10,47	1,49	9,70	40.001.085,55	13,75
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	18,84	2,30	8,36	4.250.612,64	1,46
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,14	2,33	8,32	7.457.472,78	2,56
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	19,27	2,29	6,92	5.835.119,25	2,01
BB ACOES ALO ETF	Artigo 8º II, Alínea b	19,41	2,33	7,68	2.139.991,01	0,74
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	20,43	2,46	8,11	11.055.345,35	3,80
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	20,60	2,47	8,08	5.524.145,88	1,90
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	20,83	2,54	9,27	6.508.712,90	2,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de julho 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.