



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
JUNHO 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 13.07.2020.

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 83,39%

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 | 25,14 | 3,57 | -9,73 | 36.465.729,91 | 13,33 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 25,14 | 3,57 | -9,73 | 36.465.729,91 | 13,33 |

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 | 22,66 | 2,29 | -8,42 | 16.311.470,14 | 5,96 | 273.434.802,05 | 5,97 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 12,40 | 2,02 | -1,75 | 49.621.467,92 | 18,14 | 5.526.503.185,82 | 0,90 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 12,47 | 2,03 | -1,88 | 47.256.691,38 | 17,27 | 5.979.262.081,07 | 0,79 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,95 | 1,10 | 3,04 | 7.172.565,73 | 2,62 | 8.746.335.681,60 | 0,08 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 4,10 | 1,21 | 2,88 | 3.477.987,96 | 1,27 | 6.212.458.601,64 | 0,06 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | 19,05 | 2,80 | -5,38 | 5.642.783,35 | 2,06 | 1.945.603.761,59 | 0,29 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,16 | 2,83 | -5,44 | 6.141.064,22 | 2,24 | 1.967.228.116,14 | 0,31 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 4,01 | 1,18 | 3,12 | 2.576.433,61 | 0,94 | 7.740.606.629,29 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 4,92 | 1,08 | 3,08 | 11.027.164,69 | 4,03 | 4.025.627.854,04 | 0,27 |
| BB | BB | BB PREV RF VII | 2,30 | 0,99 | 1,64 | 2.752.924,28 | 1,01 | 683.688.528,70 | 0,40 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 4,09 | 1,09 | 2,51 | 539.081,81 | 0,20 | 893.476.505,39 | 0,06 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 10,06 | 1,92 | -1,77 | 152.519.635,09 | 55,75 | | |

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 | 12,39 | 2,02 | -1,86 | 14.573.861,73 | 5,33 | 2.894.677.261,07 | 0,50 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 12,39 | 2,02 | -1,86 | 14.573.861,73 | 5,33 | | |

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 | 0,30 | 0,24 | 1,37 | 9.038.107,32 | 3,30 | 5.172.945.706,81 | 0,17 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,17 | 0,26 | 1,37 | 12.908.289,20 | 4,72 | 2.439.958.346,20 | 0,53 |
| BANESTES | BANESTES | Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI | 0,92 | 0,39 | 0,39 | 815.795,43 | 0,30 | 1.967.233.455,21 | 0,04 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,21 | 0,26 | 1,43 | 22.762.191,95 | 8,32 | | |

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 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA | 8,11 | 1,26 | 3,55 | 1.804.538,00 | 0,66 | 181.550.388,59 | 0,99 |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b | | | 8,11 | 1,26 | 3,55 | 1.804.538,00 | 0,66 | | |
| Renda Fixa | | | 12,09 | 2,06 | -3,22 | 228.125.956,68 | 83,39 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,61%

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 | 42,93 | 8,69 | -15,75 | 10.225.679,32 | 3,74 | 162.660.862,72 | 6,29 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA | 42,41 | 9,11 | -17,71 | 5.111.104,49 | 1,87 | 119.727.942,05 | 4,27 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 42,52 | 8,83 | -16,35 | 15.336.783,81 | 5,61 | | |

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 | 37,23 | 7,39 | -27,23 | 5.457.392,28 | 1,99 | 92.774.230,16 | 5,88 |
| VINCI | CEF | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 38,70 | 4,58 | -16,79 | 6.884.916,85 | 2,52 | 799.344.501,83 | 0,86 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 47,24 | 12,89 | -25,96 | 5.956.289,81 | 2,18 | 1.090.602.347,47 | 0,55 |
| BANESTES | BANESTES | Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | 44,79 | 10,23 | -8,36 | 3.922.659,84 | 1,43 | 158.247.917,35 | 2,48 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 40,68 | 8,40 | -18,69 | 22.221.258,78 | 8,12 | | |

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 | 40,47 | 9,32 | -18,26 | 1.987.375,95 | 0,73 | 169.441.735,55 | 1,17 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea b | | | 40,47 | 9,32 | -18,26 | 1.987.375,95 | 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 | 1,77 | 0,11 | 1,79 | 470.614,37 | 0,17 | 507.594.109,51 | 0,09 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 1,77 | 0,11 | 1,79 | 470.614,37 | 0,17 | | |

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 | 159,94 | -0,49 | -8,88 | 363.889,17 | 0,13 | 22.192.914,31 | 1,64 |

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 | | | 159,94 | -0,49 | -8,88 | 363.889,17 | 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 | 32,10 | 3,23 | -10,01 | 5.062.400,00 | 1,85 | 147.703.455,01 | 3,43 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b | | | 32,10 | 3,23 | -8,53 | 5.062.400,00 | 1,85 | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 36,24 | 7,81 | -16,36 | 45.442.322,08 | 16,61 | | |
| Total | | | | | | 273.568.278,76 | 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 | 36.465.729,91 | 13,33 | 10,00 | 30,00 | 70,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 152.519.635,09 | 55,75 | 20,00 | 30,00 | 80,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa Referenciados | 14.573.861,73 | 5,33 | 0,00 | 5,00 | 30,00 | 70,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 22.762.191,95 | 8,32 | 1,00 | 4,00 | 30,00 | 50,00 |
| Artigo 7º VII, Alínea b | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado" | 1.804.538,00 | 0,66 | 0,00 | 1,00 | 2,00 | 15,00 |
| | Total Renda Fixa | 228.125.956,68 | 83,39 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 15.336.783,81 | 5,61 | 1,00 | 10,00 | 10,00 | 40,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 22.221.258,78 | 8,12 | 2,00 | 15,00 | 20,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea b | Fundos de Índice de Ações | 1.987.375,95 | 0,73 | 0,00 | 0,00 | 10,00 | 30,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 470.614,37 | 0,17 | 1,00 | 0,00 | 5,00 | 10,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea a | Fundos de Participações | 363.889,17 | 0,13 | 0,00 | 0,00 | 2,00 | 5,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea b | Fundos de Investimentos Imobiliários | 5.062.400,00 | 1,85 | 1,00 | 2,00 | 4,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 45.442.322,08 | 16,61 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

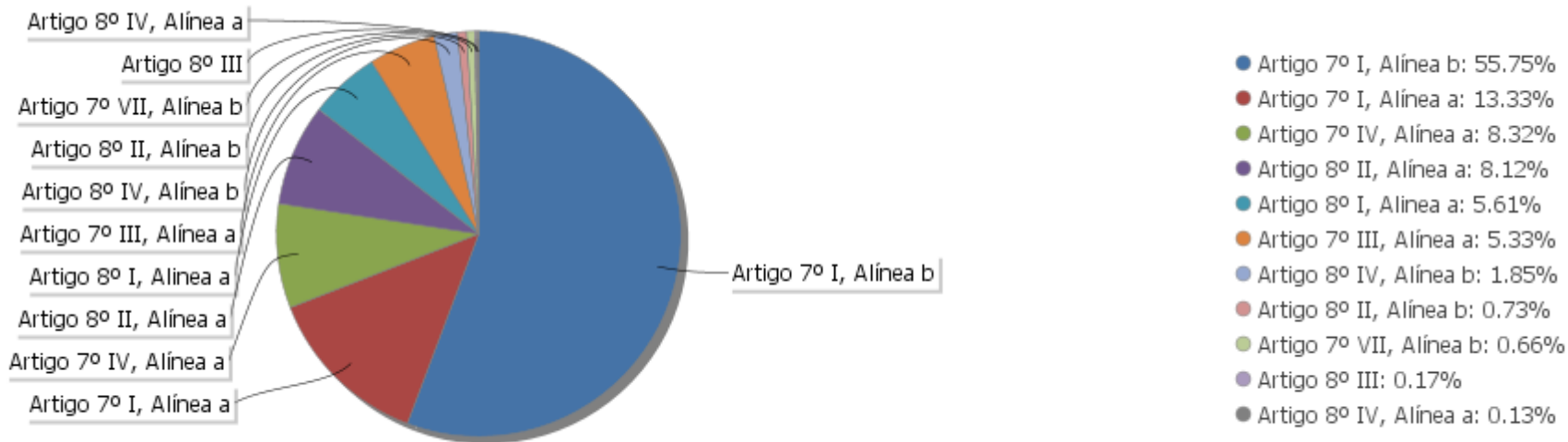
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|----------------------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|----------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 3,57 1.681,31 | -9,73 -554,44 | 6,40 870,50 | -9,73 -554,44 | | 1.256.916,12 | -4.072.882,39 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,92 904,90 | -1,77 -100,75 | 4,68 636,82 | -1,77 -100,75 | 4,51 97,99 | 2.958.247,18 | -2.889.486,42 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 2,02 953,71 | -1,86 -105,78 | 4,83 657,71 | -1,86 -105,78 | 4,56 99,02 | 289.262,00 | -275.578,94 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,26 123,06 | 1,43 81,30 | 0,69 93,63 | 1,43 81,30 | 4,10 89,02 | 41.969,12 | 160.213,06 |
| Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI | 1,26 594,89 | 3,55 202,34 | 5,02 683,48 | 3,55 202,34 | 9,75 211,79 | 22.509,00 | 61.862,00 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 8,83 0,08 | -16,35 1,45 | 30,64 0,46 | -16,35 1,45 | -4,81 1,04 | 1.244.717,69 | -1.527.926,22 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 8,40 -0,36 | -18,69 -0,89 | 27,58 -2,60 | -18,69 -0,89 | -4,86 0,99 | 1.721.529,24 | -5.419.689,33 |
| Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | 9,32 0,56 | -18,26 -0,45 | 29,74 -0,44 | -18,26 -0,45 | | 169.367,66 | -443.835,36 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 0,11 -8,65 | 1,79 19,60 | 0,62 -29,55 | 1,79 19,60 | 5,40 11,25 | 515,92 | 8.280,77 |
| Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -0,49 -9,25 | -8,88 8,92 | -7,68 -37,85 | -8,88 8,92 | -70,18 -64,33 | -1.794,14 | -35.461,26 |
| Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | 3,23 -5,53 | -8,53 9,27 | 18,60 -11,58 | -8,53 9,27 | -0,67 5,19 | 158.200,00 | -482.090,03 |
| Artigo 9º A, III % do CDI | 0,00 0,00 | 5,29 301,39 | -1,41 -192,23 | 5,29 301,39 | 22,51 489,11 | 0,00 | 370.875,59 |
| | | | | | | 7.861.439,79 | -14.545.718,53 |

Análise de Liquidez

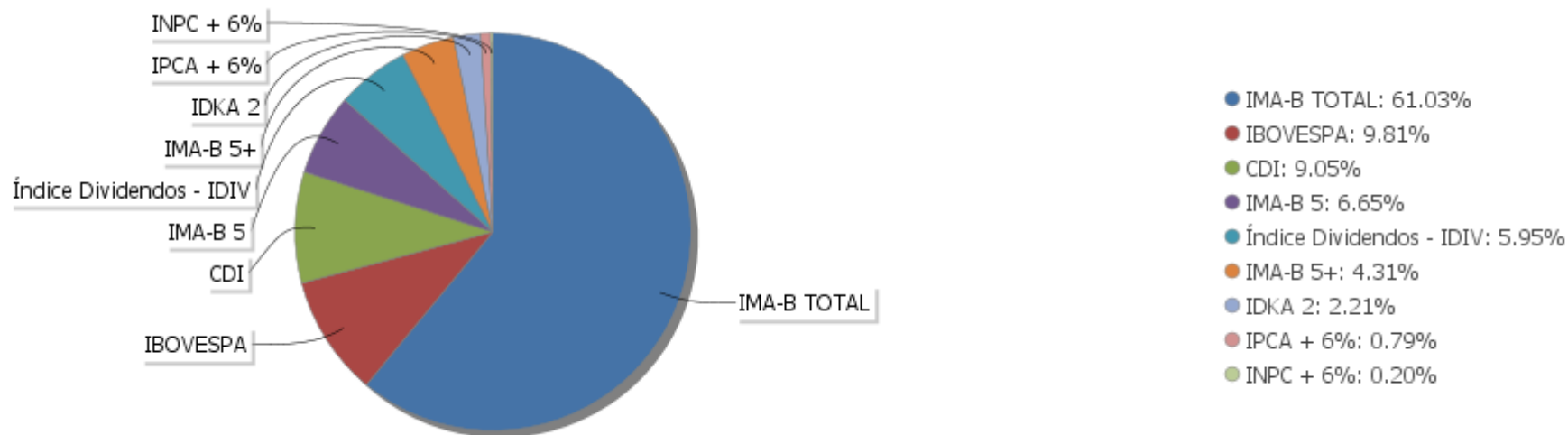
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 222.532.351,70 | 81,34 | 222.532.351,70 | 81,34 |
| de 31 a 364 dias | 11.278.191,06 | 4,12 | 233.810.542,76 | 85,47 |
| acima de 365 dias | 39.757.736,00 | 14,53 | 273.568.278,76 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

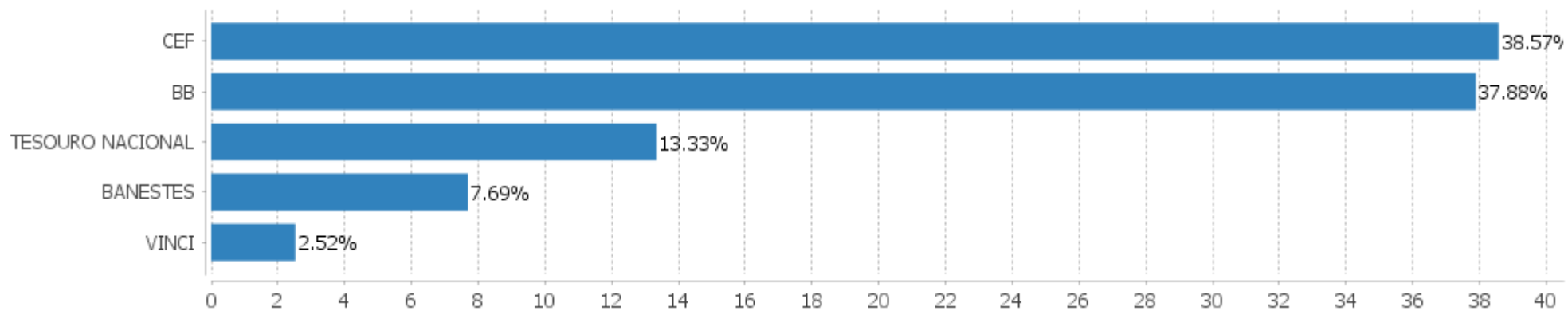


Alocação Por Estratégia



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 | -1,20 | -10,78 | 2,63 | 2,05 | 2,97 | | | | | | | -5,08 |
| IPCA + 5,86% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | | | | | | | 2,92 |
| p.p. indexador | -0,85 | -1,86 | -11,35 | 2,48 | 1,98 | 2,24 | | | | | | | -8,00 |
| 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 |

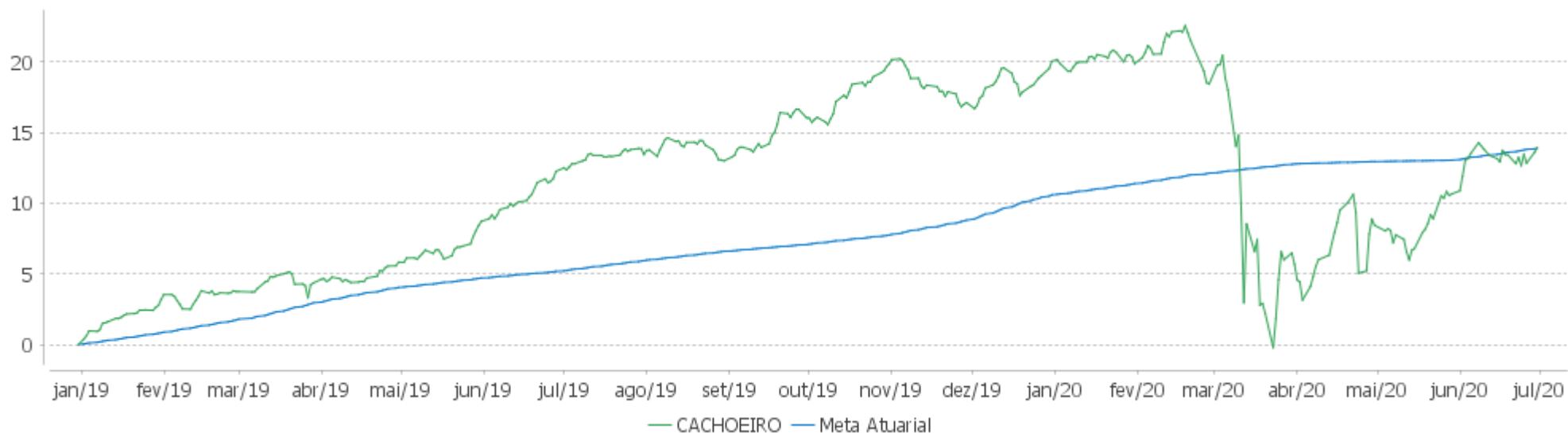
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

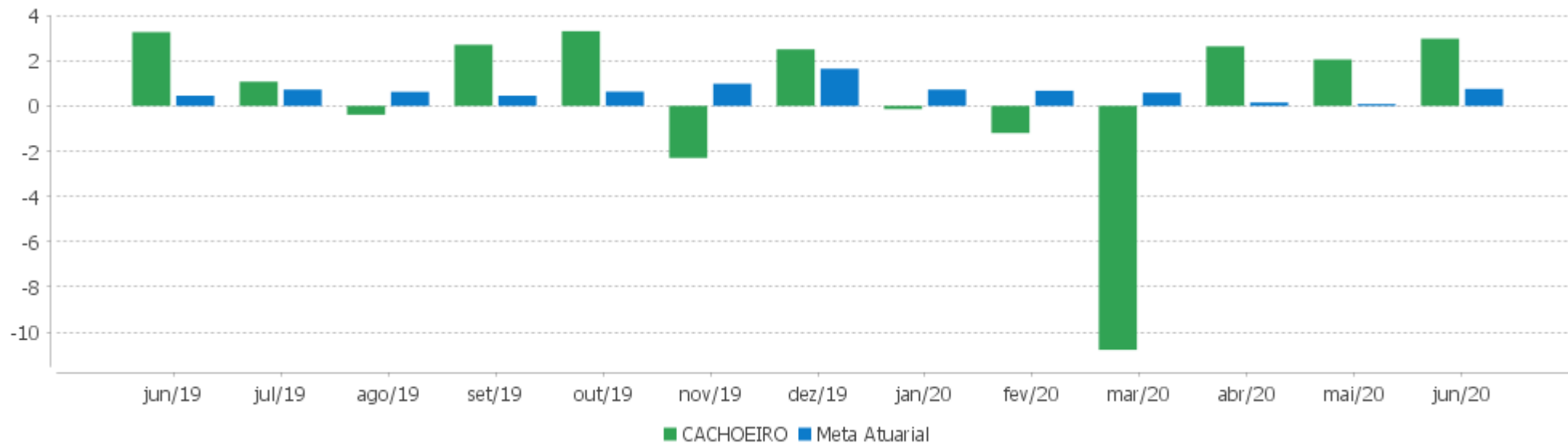
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 11 | 61,11 | 03 meses | 7,84 | 0,95 | 6,89 | 13,44 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 7 | 38,89 | 06 meses | -5,08 | 2,92 | -8,00 | 20,36 |
| | | | 12 meses | 1,52 | 8,22 | -6,70 | 14,51 |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,30 | 2019-10 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -10,78 | 2020-03 | Desde 31/12/2018 | 13,95 | 13,82 | 0,13 | 12,09 |

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. | 3,57 1,52 | -9,73 -8,06 | 6,40 1,44 | -9,73 -8,06 | -3,43 -8,37 | 41,23 6,10 | 39,53 -6,68 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA Var. IPCA + 6% p.p. | 1,26 0,52 | 3,55 0,56 | 5,02 4,04 | 3,55 0,56 | 9,75 1,46 | 27,65 9,08 | 35,15 4,04 |
| Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI % do CDI | 0,46 214,49 | -1,54 -87,93 | -0,92 -124,84 | -1,54 -87,93 | 1,07 23,33 | 7,95 70,89 | 16,49 85,04 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,26 122,46 | 1,37 78,16 | 0,78 105,60 | 1,37 78,16 | 4,06 88,25 | 10,51 93,70 | 18,70 96,43 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,24 114,33 | 1,37 78,02 | 0,58 78,30 | 1,37 78,02 | 4,03 87,52 | 10,44 93,15 | 18,40 94,90 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,03 -0,02 | -1,88 -0,21 | 4,91 -0,05 | -1,88 -0,21 | 4,52 -0,42 | 34,35 -0,78 | 45,00 -1,21 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,29 0,24 | -8,42 -6,75 | 4,76 -0,20 | -8,42 -6,75 | -0,74 -5,69 | 38,52 3,39 | 45,40 -0,80 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 1,10 -0,02 | 3,04 -0,13 | 3,71 -0,06 | 3,04 -0,13 | 8,51 -0,30 | 24,21 -0,55 | 35,98 -0,92 |
| BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,99 -1,06 | 1,64 3,31 | 2,40 -2,56 | 1,64 3,31 | 6,28 1,33 | 19,00 -16,13 | 30,65 -15,55 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 1,21 0,22 | 2,88 -0,46 | 3,57 0,22 | 2,88 -0,46 | 8,18 -0,59 | 21,13 -2,04 | 32,87 -2,59 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 1,08 -0,04 | 3,08 -0,09 | 3,71 -0,06 | 3,08 -0,09 | 8,59 -0,22 | 24,25 -0,51 | 36,09 -0,81 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 1,18 0,19 | 3,12 -0,23 | 3,54 0,19 | 3,12 -0,23 | 8,19 -0,58 | 21,36 -1,81 | 33,16 -2,29 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,02 -0,03 | -1,75 -0,08 | 4,90 -0,06 | -1,75 -0,08 | 4,74 -0,20 | 34,48 -0,65 | 45,12 -1,09 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p. | 1,09 0,30 | 2,51 -0,74 | 3,28 2,05 | 2,51 -0,74 | 7,73 -0,79 | 29,33 10,58 | 42,34 12,11 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | 2,83 -0,02 | -5,44 -0,17 | 5,88 -0,11 | -5,44 -0,17 | 1,57 -0,40 | 42,12 -1,44 | 50,48 -1,85 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p. | 2,80 -0,04 | -5,38 -0,11 | 5,82 -0,17 | -5,38 -0,11 | 1,87 -0,10 | 42,80 -0,75 | 51,23 -1,10 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 2,02 | -1,86 | 4,83 | -1,86 | 4,56 | 34,21 | 44,88 |

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. | -0,02 | -0,19 | -0,13 | -0,19 | -0,39 | -0,92 | -1,33 |
| BB ACOES ALO ETF % do CDI | 9,32 4.387,61 | -18,26 -1.040,58 | 29,74 4.047,20 | -18,26 -1.040,58 | -4,41 -95,90 | 31,20 278,27 | 52,57 271,13 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT Var. IBOVESPA p.p. | 0,11 -8,65 | 1,79 19,60 | 0,62 -29,55 | 1,79 19,60 | 5,40 11,25 | | |
| CXCE11B Var. IBOVESPA p.p. | 3,23 -5,53 | -10,01 7,80 | 17,60 -12,58 | -10,01 7,80 | -2,27 3,58 | 21,41 -9,23 | |
| FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p. | -0,49 -1,24 | -8,88 -11,87 | -7,68 -8,66 | -8,88 -11,87 | -70,18 -78,47 | -70,52 -89,08 | -70,91 -102,02 |
| BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p. | 8,69 -0,06 | -15,75 2,05 | 31,24 1,06 | -15,75 2,05 | -3,71 2,14 | 30,12 -0,51 | 49,22 -1,90 |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p. | 9,11 0,35 | -17,71 0,09 | 29,45 -0,73 | -17,71 0,09 | -6,12 -0,27 | 29,35 -1,29 | 48,47 -2,65 |
| Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 10,23 1,28 | -8,36 10,02 | 41,46 22,76 | -8,36 10,02 | 8,76 8,91 | 58,50 10,98 | 80,20 19,63 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p. | 12,89 4,14 | -21,45 -3,65 | 31,67 1,49 | -21,45 -3,65 | 3,57 9,43 | 42,14 11,50 | 61,19 10,06 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 7,39 -1,56 | -21,42 -3,04 | 23,72 5,02 | -21,42 -3,04 | -1,99 -1,83 | 28,83 -18,68 | 32,61 -27,96 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 4,58 -4,37 | -16,79 1,59 | 20,57 1,87 | -16,79 1,59 | -2,34 -2,18 | 45,78 -1,73 | 57,70 -2,87 |
| CDI | 0,21 | 1,75 | 0,73 | 1,75 | 4,60 | 11,21 | 19,39 |
| IBOVESPA | 8,76 | -17,80 | 30,18 | -17,80 | -5,85 | 30,64 | 51,12 |
| INPC + 6% | 0,79 | 3,25 | 1,24 | 3,25 | 8,51 | 18,75 | 30,23 |
| IPCA + 6% | 0,75 | 2,99 | 0,98 | 2,99 | 8,29 | 18,56 | 31,11 |

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 | 0,28 | 2,60 | 1,15 | 2,60 | 6,01 | 13,67 | 22,54 |
| IRF-M 1+ | 1,04 | 6,03 | 4,53 | 6,03 | 11,80 | 33,23 | 45,60 |
| IRF-M TOTAL | 0,79 | 4,86 | 3,39 | 4,86 | 9,81 | 27,08 | 38,44 |
| IMA-B 5 | 1,12 | 3,17 | 3,77 | 3,17 | 8,81 | 24,75 | 36,90 |
| IMA-B 5+ | 2,84 | -5,26 | 5,99 | -5,26 | 1,97 | 43,55 | 52,33 |
| IMA-B TOTAL | 2,05 | -1,66 | 4,96 | -1,66 | 4,95 | 35,13 | 46,21 |
| IMA-C TOTAL | 3,74 | 7,46 | 7,95 | 7,46 | 13,21 | 41,24 | 63,14 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,90 | 1,71 | 2,74 | 1,71 | 6,32 | 22,95 | 33,11 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,99 | 1,87 | 2,89 | 1,87 | 6,52 | 23,45 | 33,90 |
| IDKA 2 | 0,99 | 3,35 | 3,35 | 3,35 | 8,77 | 23,17 | 35,46 |
| IDKA 20 | 4,18 | -12,33 | 6,49 | -12,33 | -4,69 | 58,14 | 62,45 |
| CDI | 0,21 | 1,75 | 0,73 | 1,75 | 4,60 | 11,21 | 19,39 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | 8,76 | -17,80 | 30,18 | -17,80 | -5,85 | 30,64 | 51,12 |
| IBRX 100 | 8,97 | -17,39 | 30,39 | -17,39 | -4,66 | 34,21 | 53,90 |
| IBRX 50 | 9,33 | -17,76 | 31,79 | -17,76 | -6,93 | 27,59 | 47,47 |
| SMALL CAP | 14,43 | -20,73 | 32,49 | -20,73 | 5,15 | 49,01 | 69,83 |
| IFIX | 5,59 | -12,24 | 12,52 | -12,24 | 6,86 | 32,05 | 35,30 |
| Índice Consumo - ICON | 10,08 | -10,90 | 39,45 | -10,90 | 13,99 | 52,93 | 55,22 |
| Índice Dividendos - IDIV | 8,95 | -18,38 | 18,70 | -18,38 | -0,15 | 47,52 | 60,57 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,26 | 0,10 | -0,43 | 0,10 | 2,13 | 5,57 | 10,21 |
| INPC | 0,30 | 0,36 | -0,18 | 0,36 | 2,35 | 5,74 | 9,47 |
| IGPM | 1,56 | 4,39 | 2,66 | 4,39 | 7,31 | 14,30 | 22,21 |
| SELIC | 0,21 | 1,75 | 0,73 | 1,75 | 4,60 | 11,21 | 19,40 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|-------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------------|---------------|
| 01/06/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 100.000,00 | 27.080,89592000 | 3,6926400000 |
| 03/06/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 65.000,00 | 17.596,77346400 | 3,6938590000 |
| 03/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.771.095,16 | 0,00 | 778.935,18301900 | 2,2737388150 |
| 04/06/2020 | Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI | 812.620,04 | 0,00 | 481.138,93768512 | 1,6889509000 |
| 05/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 50.000,00 | 21.985,52703500 | 2,2742233980 |
| 08/06/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 34.000,00 | 0,00 | 9.201,31752000 | 3,6951230000 |
| 08/06/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 500.000,00 | 135.313,49292000 | 3,6951230000 |
| 08/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 34.000,00 | 0,00 | 14.948,69116900 | 2,2744466130 |
| 08/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 500.000,00 | 0,00 | 219.833,69367300 | 2,2744466130 |
| 17/06/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 105.000,00 | 0,00 | 28.393,07371200 | 3,6980850000 |
| 17/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 22.114,28 | 0,00 | 9.715,57956500 | 2,2761668360 |
| 22/06/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 3.615.000,00 | 977.302,25570000 | 3,6989580000 |
| 24/06/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 4.000.000,00 | 1.303.642,86693400 | 3,0683250000 |
| 24/06/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.000.000,00 | 0,00 | 1.081.218,42504300 | 3,6995300000 |
| 24/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.530.000,00 | 0,00 | 1.110.790,86820100 | 2,2776564630 |
| 24/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 100.000,00 | 43.904,77739900 | 2,2776564630 |
| 25/06/2020 | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 0,00 | 4.000.000,00 | 203.112,14036500 | 19,6935544710 |
| 30/06/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 3.500.000,00 | 0,00 | 1.535.994,04942900 | 2,2786546610 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

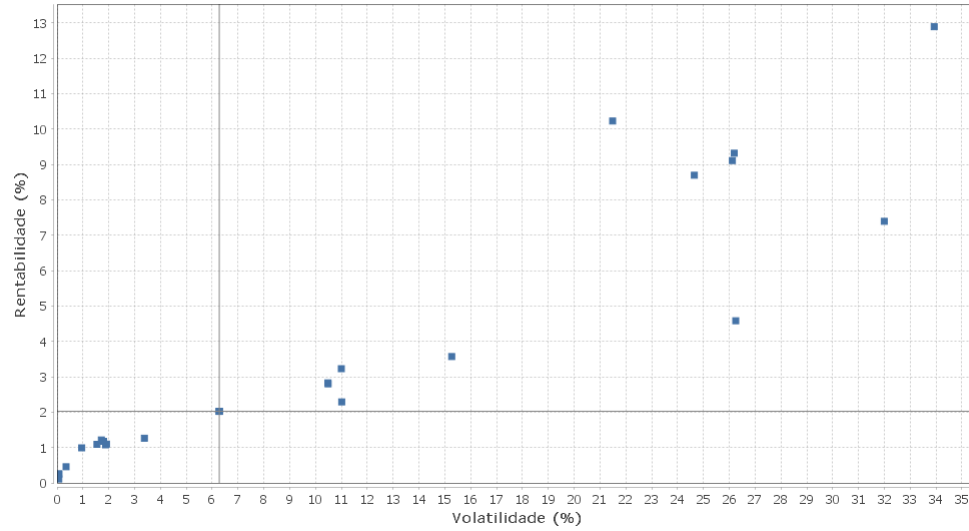
Rendimentos Realizados

| Artigo | Ativo | Quantidade | Valor Aplicação | Valor Resgate | Rendimento |
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|

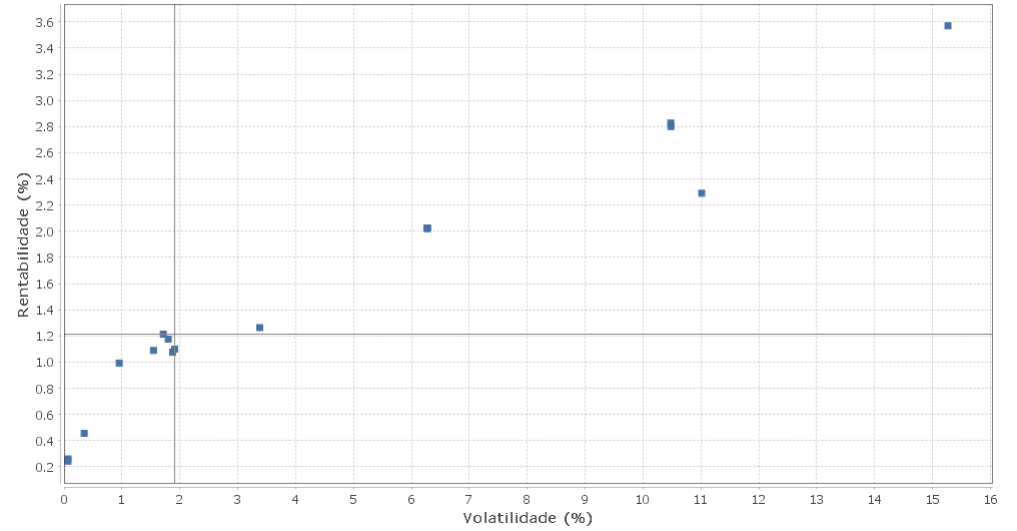
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

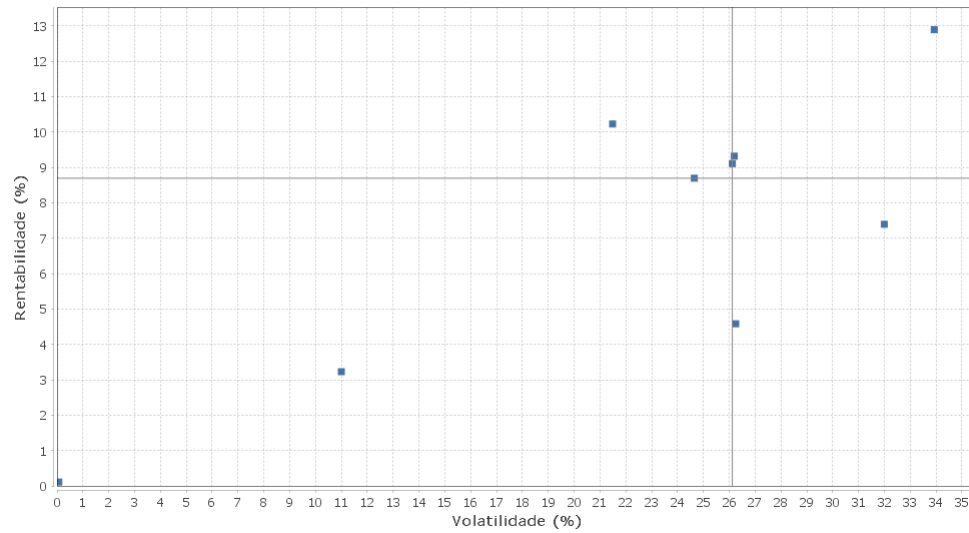
CACHOEIRO - No Mês



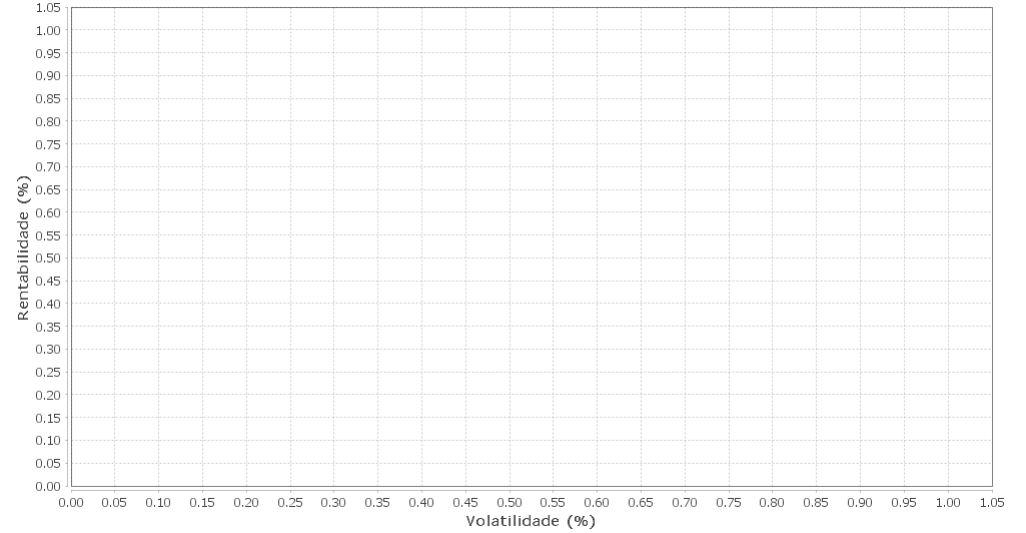
Renda Fixa - No Mês



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 | 0,07 | 0,02 | 0,24 | 9.038.107,32 | 3,30 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT | Artigo 8º III | 0,07 | 0,01 | 0,11 | 470.614,37 | 0,17 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,07 | 0,02 | 0,26 | 12.908.289,20 | 4,72 |
| Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,35 | 0,06 | 0,46 | 815.795,43 | 0,30 |
| BB PREV RF VII | Artigo 7º I, Alínea b | 0,95 | 0,15 | 0,99 | 2.752.924,28 | 1,01 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,54 | 0,21 | 1,09 | 539.081,81 | 0,20 |
| BB PREV RF IDKA2 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,71 | 0,24 | 1,21 | 3.477.987,96 | 1,27 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,80 | 0,24 | 1,18 | 2.576.433,61 | 0,94 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,88 | 0,25 | 1,08 | 11.027.164,69 | 4,03 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,91 | 0,25 | 1,10 | 7.172.565,73 | 2,62 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA | Artigo 7º VII, Alínea b | 3,38 | 0,41 | 1,26 | 1.804.538,00 | 0,66 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | Artigo 7º III, Alínea a | 6,27 | 0,74 | 2,02 | 14.573.861,73 | 5,33 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 6,27 | 0,74 | 2,02 | 49.621.467,92 | 18,14 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 6,28 | 0,75 | 2,03 | 47.256.691,38 | 17,27 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 10,48 | 1,22 | 2,83 | 6.141.064,22 | 2,24 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 10,48 | 1,22 | 2,80 | 5.642.783,35 | 2,06 |
| CXCE11B | Artigo 8º IV, Alínea b | 11,00 | 1,29 | 3,23 | 5.062.400,00 | 1,85 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B | Artigo 7º I, Alínea b | 11,01 | 1,25 | 2,29 | 16.311.470,14 | 5,96 |
| NTN-B 150555 | Artigo 7º I, Alínea a | 15,27 | 1,75 | 3,57 | 36.465.729,91 | 13,33 |
| Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | Artigo 8º II, Alínea a | 21,49 | 2,69 | 10,23 | 3.922.659,84 | 1,43 |
| BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI | Artigo 8º I, Alínea a | 24,65 | 2,95 | 8,69 | 10.225.679,32 | 3,74 |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA | Artigo 8º I, Alínea a | 26,12 | 3,12 | 9,11 | 5.111.104,49 | 1,87 |
| BB ACOES ALO ETF | Artigo 8º II, Alínea b | 26,19 | 3,14 | 9,32 | 1.987.375,95 | 0,73 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 26,25 | 2,93 | 4,58 | 6.884.916,85 | 2,52 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI | Artigo 8º II, Alínea a | 32,00 | 3,65 | 7,39 | 5.457.392,28 | 1,99 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 33,93 | 4,09 | 12,89 | 5.956.289,81 | 2,18 |