



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
MAIO 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 15.06.2020.

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 84,08%

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	25,03	0,15	-12,84	35.208.813,79	13,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		25,03	0,15	-12,84	35.208.813,79	13,29

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	22,64	0,71	-10,47	15.946.293,94	6,02	260.165.233,98	6,13
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	12,41	1,50	-3,69	48.639.176,38	18,37	5.454.809.775,70	0,89
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	12,48	1,50	-3,82	46.318.648,29	17,49	5.962.762.833,75	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00	2,11	1,92	11.076.331,57	4,18	8.882.233.150,63	0,12
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	2,00	1,65	3.436.305,14	1,30	6.335.156.883,21	0,05
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	19,00	1,00	-7,95	5.489.086,29	2,07	1.970.647.318,20	0,28
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO	19,11	1,00	-8,04	5.972.215,23	2,26	1.931.164.845,98	0,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,03	1,91	1,92	2.546.505,13	0,96	7.977.728.907,89	0,03
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,97	2,11	1,99	14.877.678,16	5,62	4.431.593.608,10	0,34
BB	BB	BB PREV RF VII	2,34	1,25	0,64	2.725.875,37	1,03	676.970.933,69	0,40
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,14	1,83	1,41	533.272,41	0,20	883.847.989,19	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,07	1,50	-3,62	157.561.387,91	59,50		

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	12,40	1,49	-3,80	14.284.599,73	5,39	2.853.203.781,55	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,40	1,49	-3,80	14.284.599,73	5,39		
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	0,33	1,12	9.158.299,67	3,46	4.656.011.205,04	0,20
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,11	4.683.093,68	1,77	2.574.764.271,12	0,18
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,21	0,31	1,16	13.841.393,35	5,23		
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	8,18	2,82	2,26	1.782.029,00	0,67	179.285.884,52	0,99
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			8,18	2,82	2,26	1.782.029,00	0,67		
Renda Fixa			12,06	1,21	-5,18	222.678.223,78	84,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,92%

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	42,72	8,16	-22,49	9.407.695,47	3,55	142.560.833,99	6,60
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	42,11	7,85	-24,58	4.684.370,65	1,77	107.680.207,26	4,35
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			42,27	8,06	-23,14	14.092.066,12	5,32		

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	36,41	5,61	-32,24	5.081.776,55	1,92	82.941.785,62	6,13
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,32	7,50	-20,43	6.583.211,57	2,49	768.284.939,45	0,86
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	46,53	4,76	-34,42	5.276.035,28	1,99	950.738.261,40	0,55
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	44,70	10,24	-16,86	3.558.706,14	1,34	141.474.377,54	2,52
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,20	6,77	-24,99	20.499.729,54	7,74		

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	40,09	6,84	-25,22	1.818.008,29	0,69	152.262.042,45	1,19
Sub-total Artigo 8º II, Alínea b			40,09	6,84	-25,22	1.818.008,29	0,69		

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	1,81	0,26	1,68	470.098,45	0,18	507.037.648,57	0,09
Sub-total Artigo 8º III			1,81	0,26	1,68	470.098,45	0,18		

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	160,57	-6,67	-8,43	365.683,31	0,14	22.192.914,31	1,65
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			160,57	-6,67	-8,43	365.683,31	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	32,75	4,30	-12,82	4.904.200,00	1,85	147.703.455,01	3,32
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			32,75	4,30	-11,39	4.904.200,00	1,85		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			35,89	6,70	-22,42	42.149.785,71	15,92		
Total						264.828.009,49	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	35.208.813,79	13,29	10,00	30,00	70,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	157.561.387,91	59,50	20,00	30,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	14.284.599,73	5,39	0,00	5,00	30,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	13.841.393,35	5,23	1,00	4,00	30,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.782.029,00	0,67	0,00	1,00	2,00	15,00
	Total Renda Fixa	222.678.223,78	84,08				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	14.092.066,12	5,32	1,00	10,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	20.499.729,54	7,74	2,00	15,00	20,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea b	Fundos de Índice de Ações	1.818.008,29	0,69	0,00	0,00	10,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	470.098,45	0,18	1,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	365.683,31	0,14	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.904.200,00	1,85	1,00	2,00	4,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	42.149.785,71	15,92				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

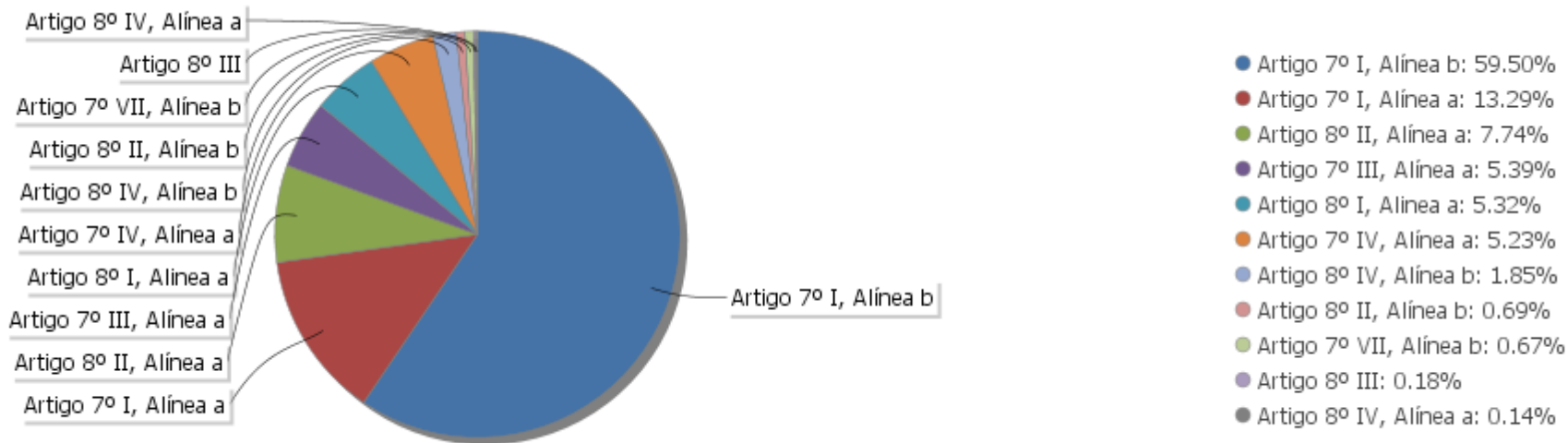
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,15 63,34	-12,84 -834,33	-12,05 -1.398,98	-9,64 -502,02		32.856,73	-5.329.798,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,50 634,84	-3,62 -235,21	-4,35 -504,49	-1,84 -96,10	5,84 119,83	2.323.891,42	-5.847.733,60
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,49 630,18	-3,80 -247,19	-4,44 -515,37	-1,89 -98,36	6,26 128,45	209.161,20	-564.840,94
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,31 129,72	1,16 75,51	0,53 61,45	1,52 79,41	4,31 88,40	41.085,47	118.243,94
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	2,82 1.194,51	2,26 146,75	0,70 80,67	3,76 195,76	11,39 233,91	48.820,00	39.353,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,06 -0,51	-23,14 1,28	-14,79 1,31	-18,11 1,14	-9,09 0,84	1.050.624,16	-2.772.643,91
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	6,77 -1,80	-24,99 -0,57	-18,68 -2,58	-18,94 0,31	-7,84 2,08	1.299.947,03	-7.141.218,57
Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	6,84 -1,72	-25,22 -0,80	-17,78 -1,69	-19,32 -0,07		116.433,25	-613.203,02
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,26 -8,30	1,68 26,10	1,09 17,19	2,01 21,26	6,33 16,25	1.238,06	7.764,85
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,67 -15,24	-8,43 15,99	-7,63 8,47	-8,97 10,28	-70,05 -60,13	-26.143,73	-33.667,12
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	4,30 -4,27	-11,39 13,03	-3,49 12,61	-3,40 15,85	2,79 12,71	202.515,14	-640.290,03
Artigo 9º A, III % do CDI	0,00 0,00	5,29 343,62	4,80 557,40	3,44 178,98	27,26 559,57	0,00	370.875,59
						5.300.428,73	-22.407.158,32

Análise de Liquidez

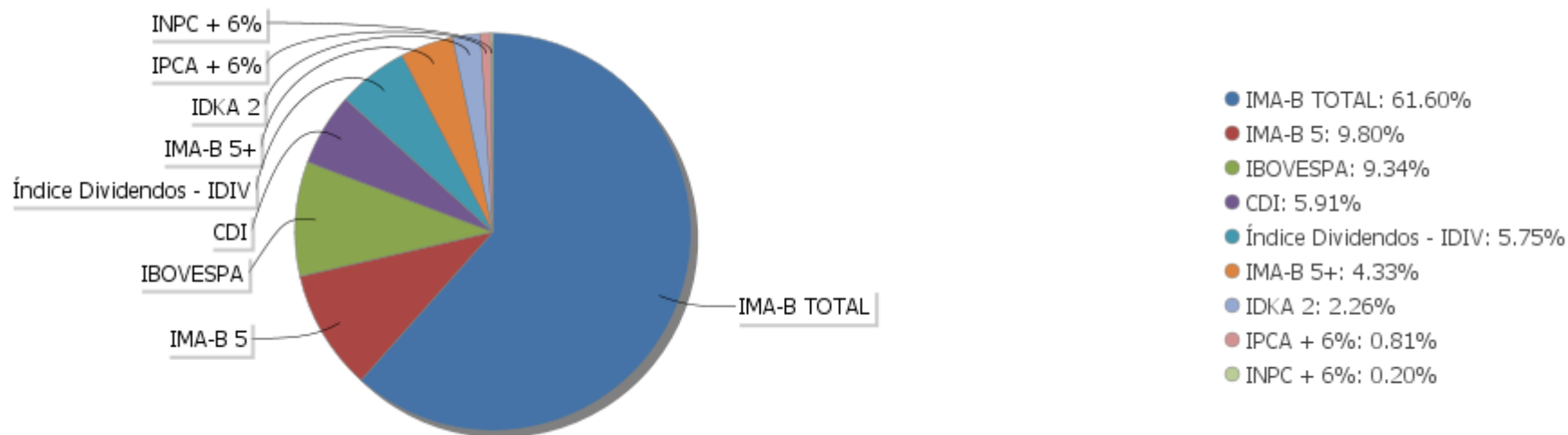
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	215.748.031,76	81,47	215.748.031,76	81,47
de 31 a 364 dias	10.612.016,16	4,01	226.360.047,92	85,47
acima de 365 dias	38.467.961,57	14,53	264.828.009,49	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

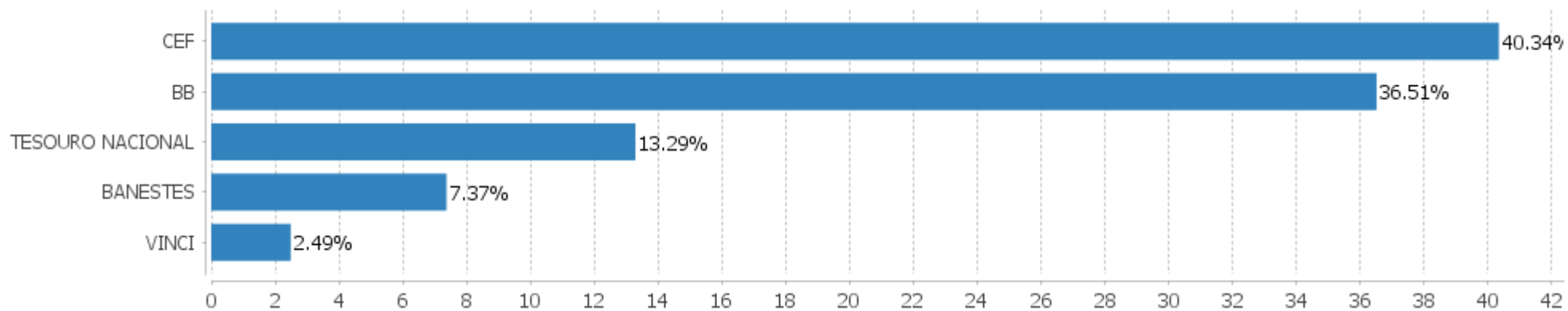


Alocação Por Estratégia



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								-7,82
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07								2,17
p.p. indexador	-0,85	-1,86	-11,35	2,48	1,98								-9,99
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

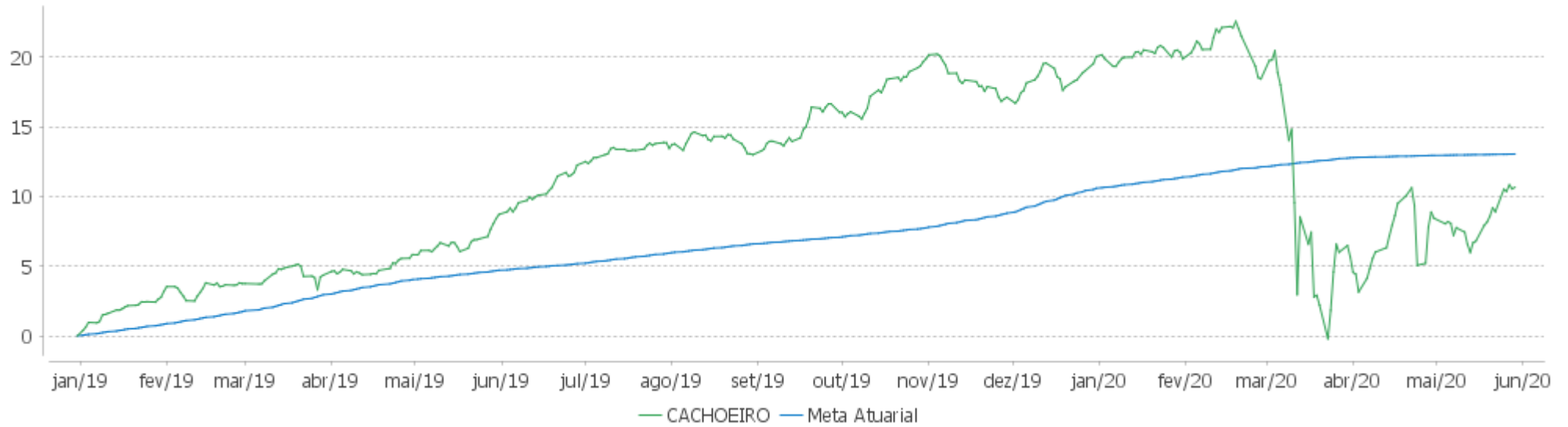
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

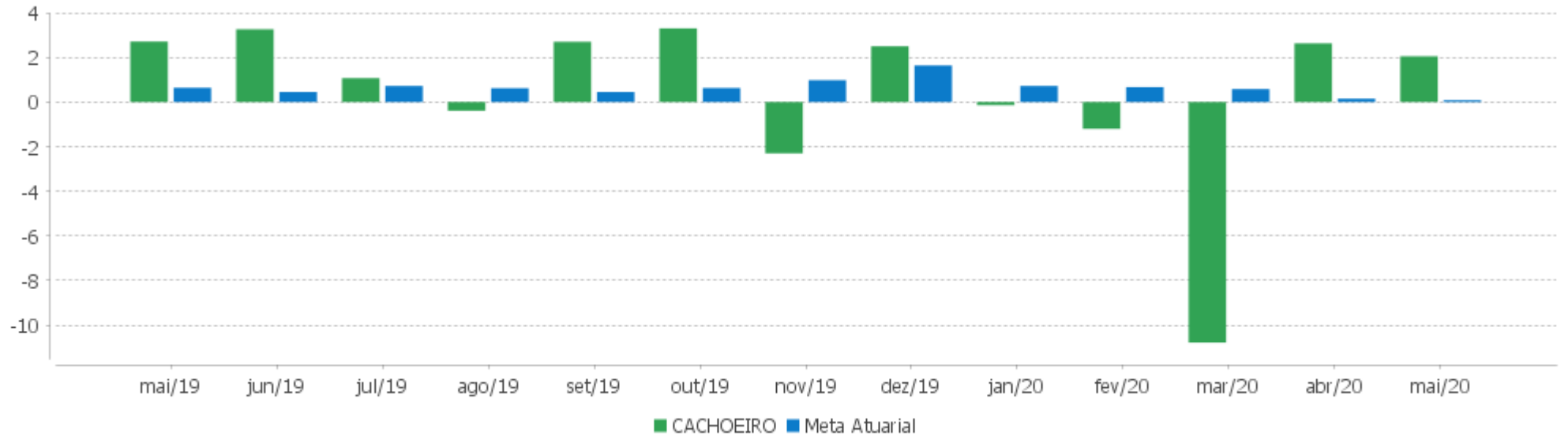
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	10	58,82	03 meses	-6,57	0,78	-7,35	27,86
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	41,18	06 meses	-5,52	3,84	-9,36	20,22
			12 meses	1,80	7,91	-6,11	14,43
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,30	2019-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,78	2020-03	Desde 31/12/2018	10,66	12,99	-2,33	12,30

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
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,82 -0,19	-4,48 -0,16	-1,91 -0,20	6,23 -0,45	31,21 -0,78	42,33 -1,17
Banestes Previdenciario FI Renda Fixa IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,71 -0,81	-10,47 -6,83	-11,02 -6,71	-8,17 -6,46	2,16 -4,52	33,67 1,67	42,63 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,02	1,92 -0,11	0,74 -0,08	3,15 -0,14	9,15 -0,31	23,37 -0,56	35,19 -0,90
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 -0,27	0,64 4,28	0,03 4,35	1,57 3,27	6,31 -0,37	18,52 -13,48	30,05 -13,46
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,00 0,25	1,65 -0,68	0,63 -0,47	2,82 -0,74	8,06 -0,97	20,02 -2,15	32,08 -3,11
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,01	1,99 -0,04	0,77 -0,05	3,20 -0,09	9,26 -0,20	23,45 -0,48	35,33 -0,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,91 0,15	1,92 -0,41	0,85 -0,24	3,04 -0,52	8,24 -0,79	20,20 -1,97	32,44 -2,76
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,69 -0,06	-4,36 -0,04	-1,79 -0,09	6,48 -0,20	31,36 -0,64	42,46 -1,05
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,83 1,62	1,41 -1,04	0,43 -0,71	2,52 -1,68	8,26 0,11	29,72 9,62	41,51 12,06
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO Var. IMA-B 5+ p.p.	1,00 -0,02	-8,04 -0,15	-8,27 -0,06	-5,68 -0,20	3,72 -0,45	36,70 -1,38	46,24 -1,80
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	1,00 -0,03	-7,95 -0,07	-8,27 -0,06	-5,45 0,04	4,09 -0,07	37,43 -0,65	46,99 -1,05
NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -1,37	-12,84 -9,20	-12,05 -7,73	-9,64 -7,93	-0,65 -7,33	34,05 2,06	34,21 -9,30
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,03	-3,80 -0,17	-4,44 -0,12	-1,89 -0,18	6,26 -0,42	31,07 -0,92	42,17 -1,34
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA Var. IPCA + 6% p.p.	2,82 2,73	2,26 0,04	0,70 -0,12	3,76 -0,14	11,39 3,43	26,27 6,52	34,28 3,82
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 108,46	1,11 72,02	0,48 55,88	1,47 76,39	4,27 87,61	10,77 93,25	19,35 96,29
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,33 139,24	1,12 73,00	0,47 55,08	1,48 77,07	4,25 87,22	10,73 92,88	19,09 94,97
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	6,55	-16,86	-12,28	-10,89	3,44	41,18	66,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,54	8,22	6,59	6,71	8,94	11,64	21,26
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	4,76	-30,42	-24,26	-21,69	-2,38	20,38	42,95
Var. IBOVESPA p.p.	-3,80	-6,00	-8,16	-2,45	7,55	6,50	3,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	5,61	-26,83	-20,39	-19,01	-4,97	17,09	20,17
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,61	-1,75	-1,52	-1,41	0,53	-12,45	-25,42
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	7,50	-20,43	-16,30	-13,65	-1,18	31,96	50,60
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,50	4,65	2,56	3,95	4,33	2,42	5,01
BB ACOES ALO ETF	6,84	-25,22	-17,78	-19,32	-9,18	14,95	39,55
% do CDI	2.901,80	-1.639,10	-2.064,28	-1.006,48	-188,41	129,39	196,78
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	8,16	-22,49	-14,11	-17,52	-7,93	13,26	36,84
Var. IBOVESPA p.p.	-0,41	1,93	1,99	1,73	2,00	-0,62	-2,53
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	7,85	-24,58	-16,20	-19,50	-10,56	12,39	36,28
Var. IBOVESPA p.p.	-0,72	-0,16	-0,10	-0,25	-0,64	-1,49	-3,09
CXCE11B	3,41	-12,82	-5,05	-5,21	1,13	24,13	
Var. IBOVESPA p.p.	-5,15	11,60	11,05	14,04	11,05	10,25	
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	-6,67	-8,43	-7,63	-8,97	-70,05	-70,41	-70,81
Var. IPCA + 6% p.p.	-6,75	-10,65	-8,44	-12,87	-78,02	-90,16	-101,27
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	0,26	1,68	1,09	2,01	6,33		
Var. IBOVESPA p.p.	-8,30	26,10	17,19	21,26	16,25		
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

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	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	3,59	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	0,80	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
Renda Variável							
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,93	6,51	14,67	19,57
SELIC	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,11
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
05/05/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.708.638,84	0,00	753.617,77399000	2,2672485960
05/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	500.000,00	135.819,96140540	3,6813440000
05/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.821,51	0,00	31.190,10611342	3,6813440000
06/05/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	100.000,00	0,00	44.097,19335300	2,2677180200
06/05/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	450.000,00	0,00	198.437,37009200	2,2677180200
06/05/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.114,28	0,00	9.751,77681000	2,2677180200
19/05/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.213,36543000	2,2704280000
20/05/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.114,28	0,00	9.738,70496200	2,2707618810
21/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	153.000,00	0,00	41.486,02395506	3,6879890000
26/05/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.007,39212500	2,2719638800
28/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.708,73806395	3,6917560000
28/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.821,51	0,00	31.102,13946967	3,6917560000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

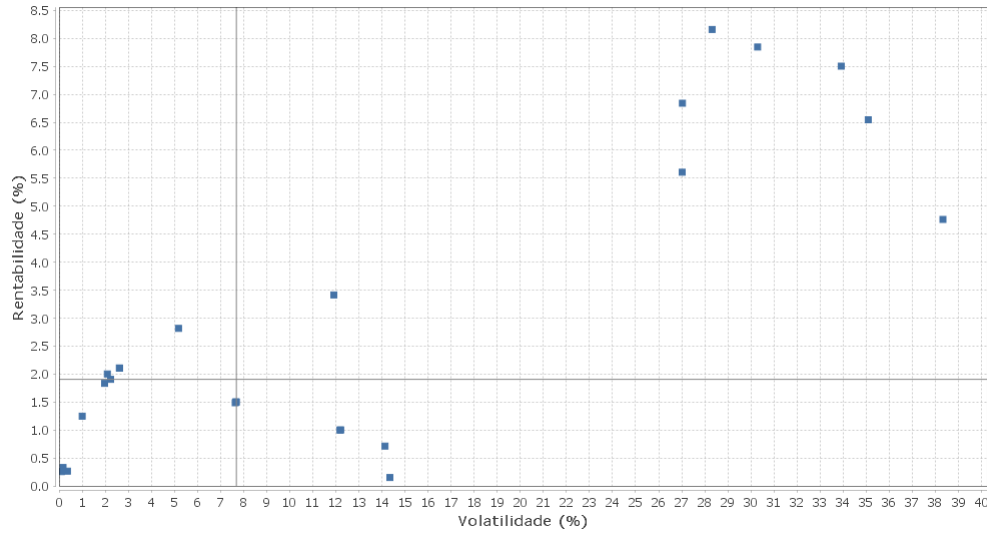
Rendimentos Realizados

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

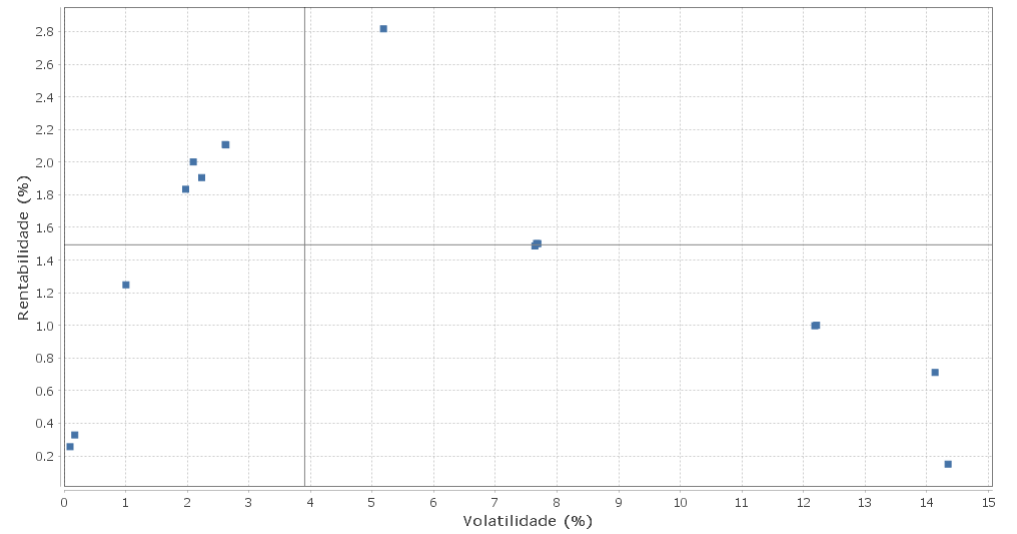
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

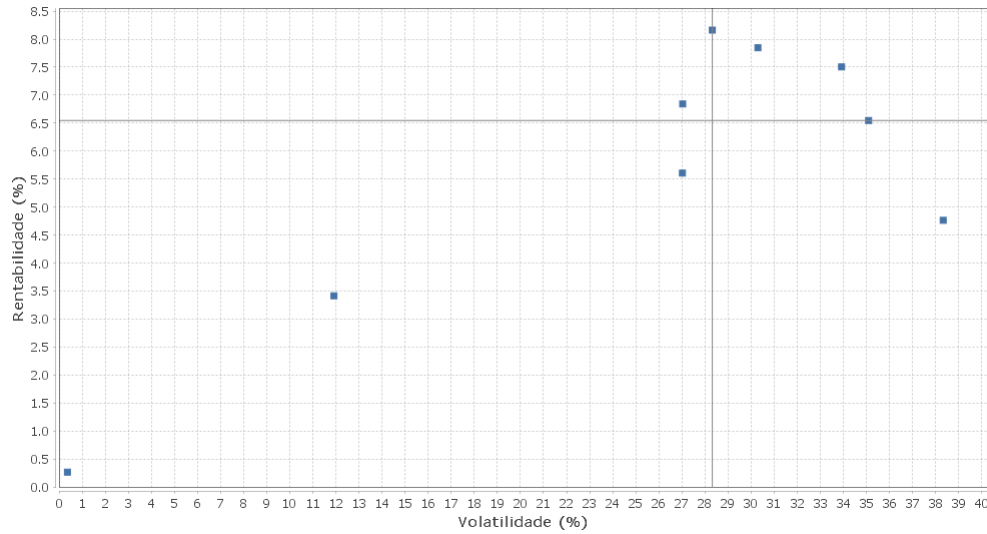
CACHOEIRO - No Mês



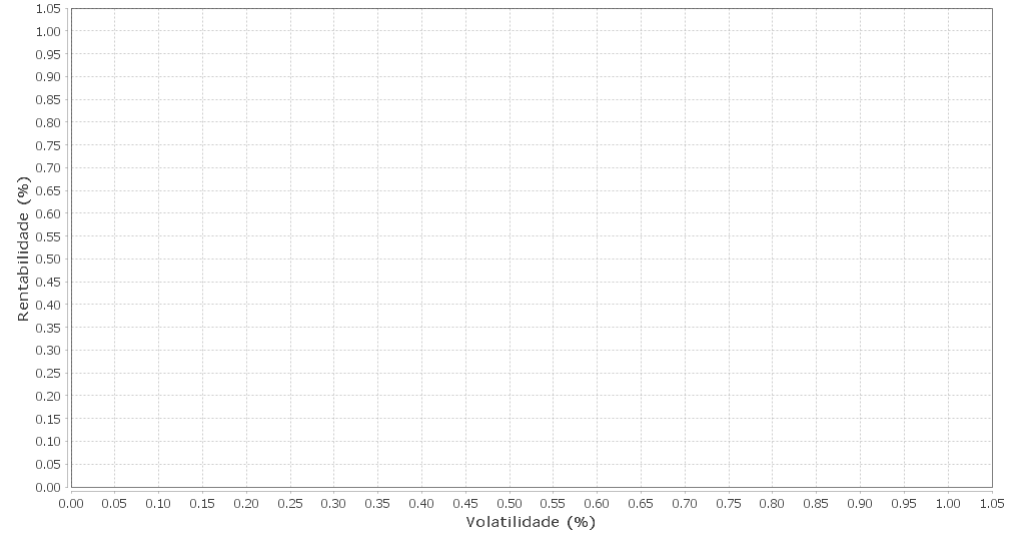
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,02	0,26	4.683.093,68	1,77
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,18	0,03	0,33	9.158.299,67	3,46
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	Artigo 8º III	0,37	0,05	0,26	470.098,45	0,18
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,17	1,25	2.725.875,37	1,03
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,97	0,30	1,83	533.272,41	0,20
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,10	0,32	2,00	3.436.305,14	1,30
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,23	0,33	1,91	2.546.505,13	0,96
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,62	0,38	2,11	14.877.678,16	5,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,63	0,38	2,11	11.076.331,57	4,18
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA	Artigo 7º VII, Alínea b	5,18	0,68	2,82	1.782.029,00	0,67
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	7,64	0,87	1,49	14.284.599,73	5,39
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	0,87	1,50	48.639.176,38	18,37
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	0,87	1,50	46.318.648,29	17,49
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	11,91	1,40	3,41	4.904.200,00	1,85
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	12,18	1,31	1,00	5.489.086,29	2,07
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	12,21	1,31	1,00	5.972.215,23	2,26
Banestes Previdenciario FI Renda Fixa IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	14,13	1,50	0,71	15.946.293,94	6,02
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	14,34	1,49	0,15	35.208.813,79	13,29
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,02	3,07	5,61	5.081.776,55	1,92
BB ACOES ALO ETF	Artigo 8º II, Alínea b	27,03	3,13	6,84	1.818.008,29	0,69
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	28,32	3,33	8,16	9.407.695,47	3,55
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	30,29	3,52	7,85	4.684.370,65	1,77
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	33,92	3,88	7,50	6.583.211,57	2,49
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	35,09	3,95	6,55	3.558.706,14	1,34
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	Artigo 8º II, Alínea a	38,32	4,20	4,76	5.276.035,28	1,99