



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
MARÇO 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 23.04.2020.

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 82,53%

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	22,51	-14,39	-15,15	35.084.706,49	14,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		22,51	-14,39	-15,15	35.084.706,49	14,00

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	20,16	-13,12	-12,58	15.570.010,86	6,21	244.950.986,31	6,36
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-6,33	47.305.604,95	18,87	5.743.378.118,49	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	45.046.837,24	17,97	5.890.819.394,91	0,76
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	10.797.716,48	4,31	9.363.308.744,85	0,12
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	3,77	-1,66	-0,66	3.358.036,64	1,34	6.723.745.548,10	0,05
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	16,80	-10,89	-10,58	5.332.537,58	2,13	1.940.264.057,52	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	16,90	-10,91	-10,68	5.800.250,44	2,31	1.935.373.241,51	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,65	-1,45	-0,41	2.488.295,49	0,99	8.199.299.170,30	0,03
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,56	-1,79	-0,60	14.499.998,82	5,78	4.397.326.460,64	0,33
BB	BB	BB PREV RF VII	2,22	-1,34	-0,74	2.688.429,15	1,07	667.671.168,60	0,40
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	3,85	-1,71	-0,75	521.942,42	0,21	865.069.606,77	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,87	-6,87	-6,16	153.409.660,07	61,20		

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	11,08	-7,00	-6,38	13.901.962,19	5,55	2.791.754.446,71	0,50
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			11,08	-7,00	-6,38	13.901.962,19	5,55		

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	0,11	0,14	0,79	2.510.279,11	1,00	5.503.080.783,31	0,05
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	-0,03	0,59	247.523,96	0,10	2.725.355.805,79	0,01
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,12	0,10	0,73	2.757.803,07	1,10		

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	7,37	-2,91	-1,40	1.718.240,00	0,69	181.127.004,20	0,95
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			7,37	-2,91	-1,40	1.718.240,00	0,69		
Renda Fixa			10,67	-7,98	-7,54	206.872.371,82	82,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

14,31%

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	40,46	-28,86	-35,80	7.791.830,28	3,11	106.197.091,53	7,34
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	39,50	-29,37	-36,43	3.948.310,83	1,58	86.348.577,23	4,57
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			39,87	-29,01	-35,97	11.740.141,11	4,68		

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	34,38	-30,90	-41,19	4.410.953,40	1,76	71.148.618,19	6,20
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	35,44	-27,40	-30,98	5.710.310,79	2,28	668.247.605,13	0,85
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	43,23	-35,06	-43,77	4.523.713,11	1,80	894.019.781,17	0,51
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	41,50	-31,64	-35,22	2.773.027,90	1,11	109.237.299,41	2,54
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			37,48	-30,90	-36,27	17.418.005,20	6,95		

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	37,67	-30,73	-36,99	1.531.808,84	0,61	126.713.999,42	1,21
Sub-total Artigo 8º II, Alínea b			37,67	-30,73	-36,99	1.531.808,84	0,61		

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	1,84	0,57	1,16	467.696,55	0,19	504.709.364,08	0,09
Sub-total Artigo 8º III			1,84	0,57	1,16	467.696,55	0,19		

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	159,18	-0,44	-1,30	394.145,61	0,16	22.192.914,31	1,78
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			159,18	-0,44	-1,30	394.145,61	0,16		
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	31,60	-16,00	-23,47	4.304.940,00	1,72	147.643.134,95	2,92
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			31,60	-16,00	-22,88	4.304.940,00	1,72		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			33,57	-27,81	-34,07	35.856.737,31	14,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,16%

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 NIVEL I	23,76	6,30	6,80	7.925.386,89	3,16	876.229.505,18	0,90
Sub-total Artigo 9º A, III			23,76	6,30	6,80	7.925.386,89	3,16		
Investimentos no Exterior			23,76	6,30	6,80	7.925.386,89	3,16		
Total						250.654.496,02	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	35.084.706,49	14,00	10,00	30,00	70,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	153.409.660,07	61,20	20,00	30,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	13.901.962,19	5,55	0,00	5,00	30,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	2.757.803,07	1,10	1,00	4,00	30,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.718.240,00	0,69	0,00	1,00	2,00	5,00
	Total Renda Fixa	206.872.371,82	82,53				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	11.740.141,11	4,68	1,00	10,00	10,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	17.418.005,20	6,95	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º II, Alínea b	Fundos de Índice de Ações	1.531.808,84	0,61	0,00	0,00	10,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	467.696,55	0,19	1,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	394.145,61	0,16	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.304.940,00	1,72	1,00	2,00	4,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	35.856.737,31	14,31				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	7.925.386,89	3,16	2,00	3,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	7.925.386,89	3,16				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

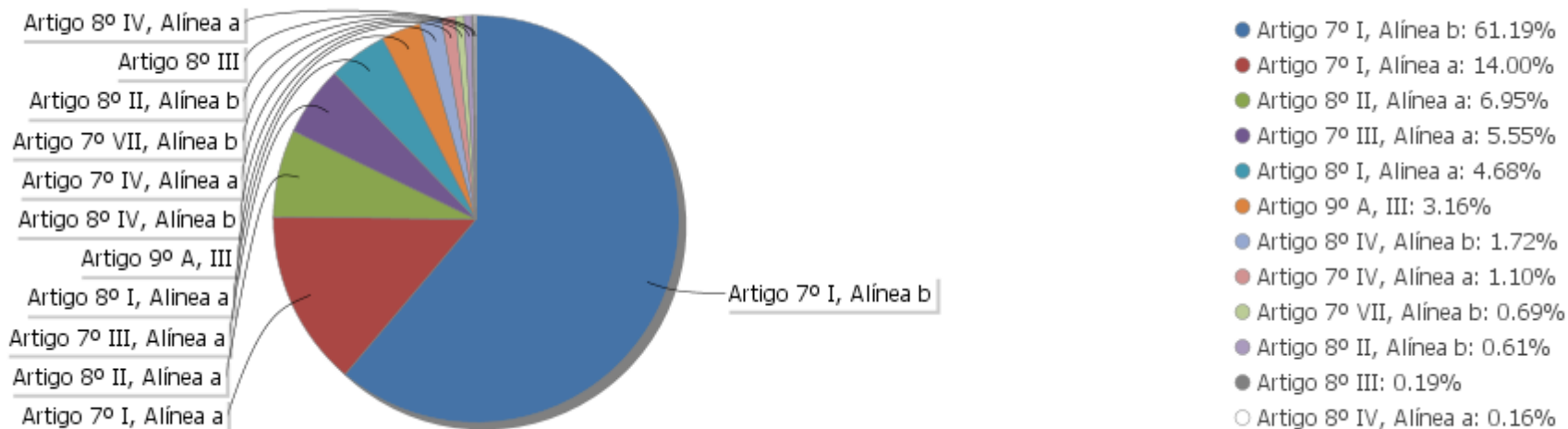
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-14,39 -4.252,59	-15,15 -1.497,32	-15,15 -1.497,32	-13,83 -610,98		-5.897.061,53	-6.266.536,47
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-6,87 -2.029,40	-6,16 -608,54	-6,16 -608,54	-3,65 -161,00	7,61 140,02	-11.308.396,51	-9.999.461,44
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-7,00 -2.068,69	-6,38 -630,43	-6,38 -630,43	-3,82 -168,66		-1.046.354,47	-947.478,48
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,10 30,54	0,73 72,45	0,73 72,45	1,84 81,22	4,98 91,58	9.165,66	49.499,40
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-2,91 -859,84	-1,40 -138,54	-1,40 -138,54	1,20 53,08	11,23 206,60	-51.489,00	-24.436,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-29,01 0,89	-35,97 0,89	-35,97 0,89	-29,64 0,65	-23,01 0,46	-3.550.346,48	-5.124.568,92
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,90 -1,00	-36,27 0,59	-36,27 0,59	-28,67 1,62	-18,67 4,80	-7.538.698,44	-10.222.942,91
Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-30,73 -0,82	-36,99 -0,14	-36,99 -0,14	-29,34 0,94		-679.465,68	-899.402,47
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,57 30,48	1,16 38,02	1,16 38,02	2,71 33,00	7,73 31,21	2.661,39	5.362,95
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,44 29,47	-1,30 35,56	-1,30 35,56	-2,65 27,64	-67,78 -44,31	-1.728,63	-5.204,82
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-16,00 13,90	-22,88 13,98	-22,88 13,98	-7,61 22,67	-1,97 21,51	-819.805,17	-1.280.185,17
Artigo 9º A, III % do CDI	6,30 1.863,01	6,80 671,49	6,80 671,49	12,71 561,33	27,06 497,76	469.979,29	504.342,72
						-30.411.539,57	-34.211.011,61

Análise de Liquidez

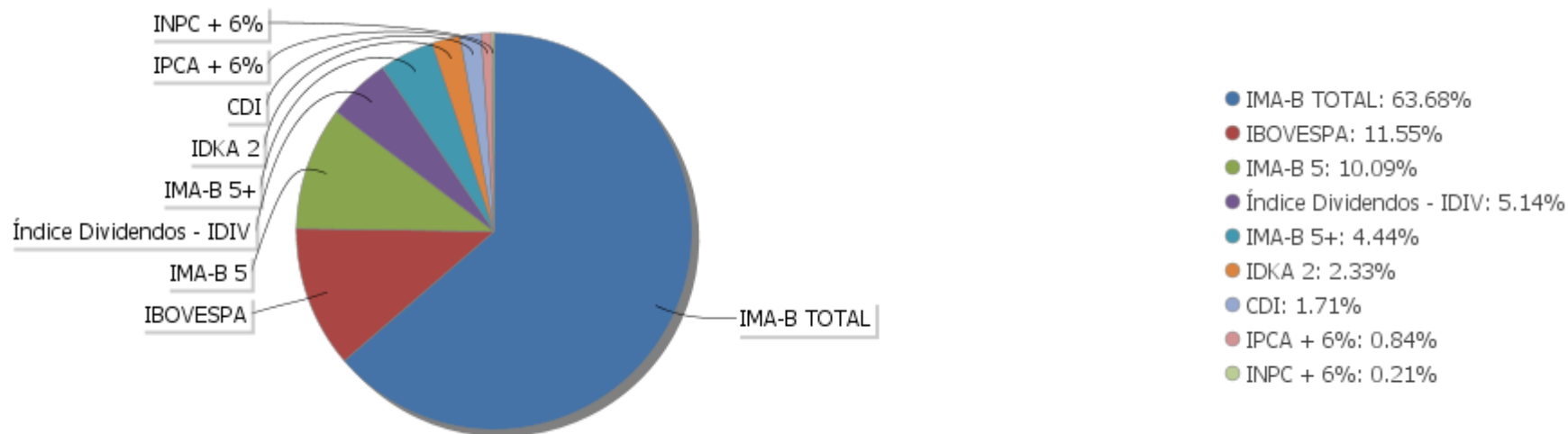
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	203.408.382,72	81,15	203.408.382,72	81,15
de 31 a 364 dias	8.951.035,24	3,57	212.359.417,96	84,72
acima de 365 dias	38.295.078,06	15,28	250.654.496,02	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

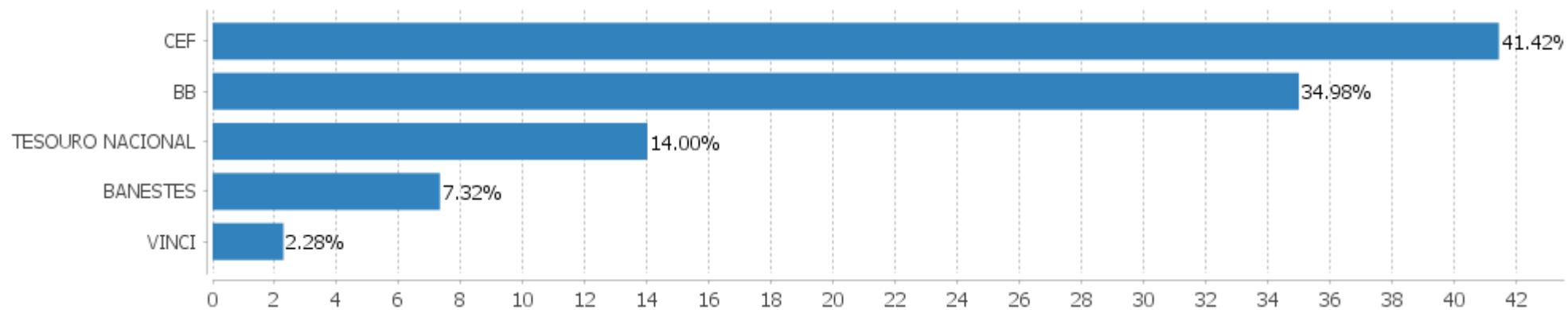


Alocação Por Estratégia



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										-11,98
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57										1,95
p.p. indexador	-0,85	-1,86	-11,35										-13,93
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

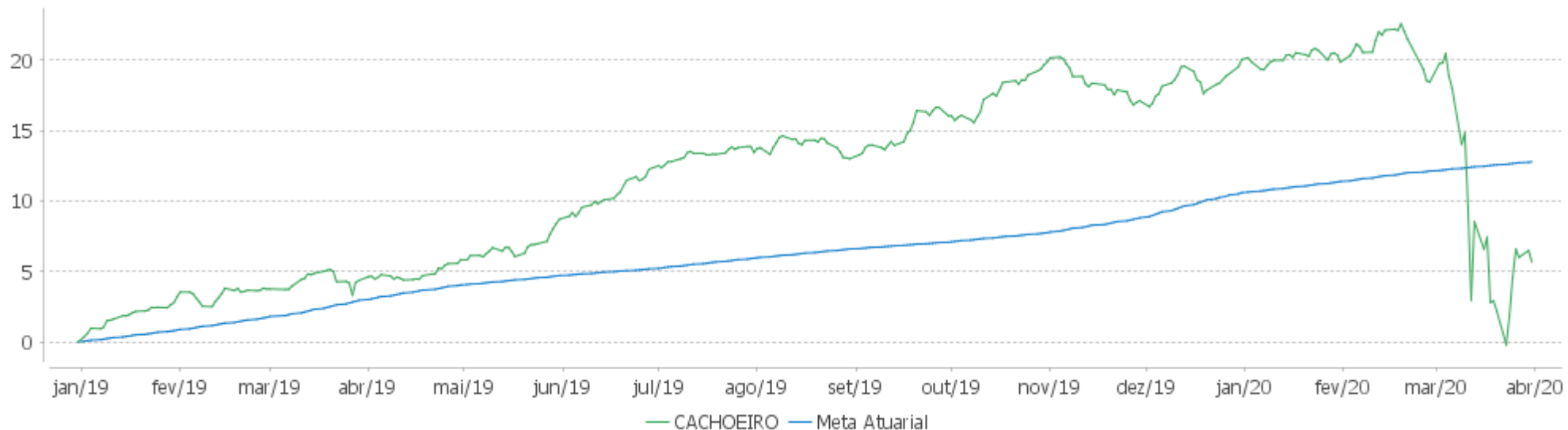
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

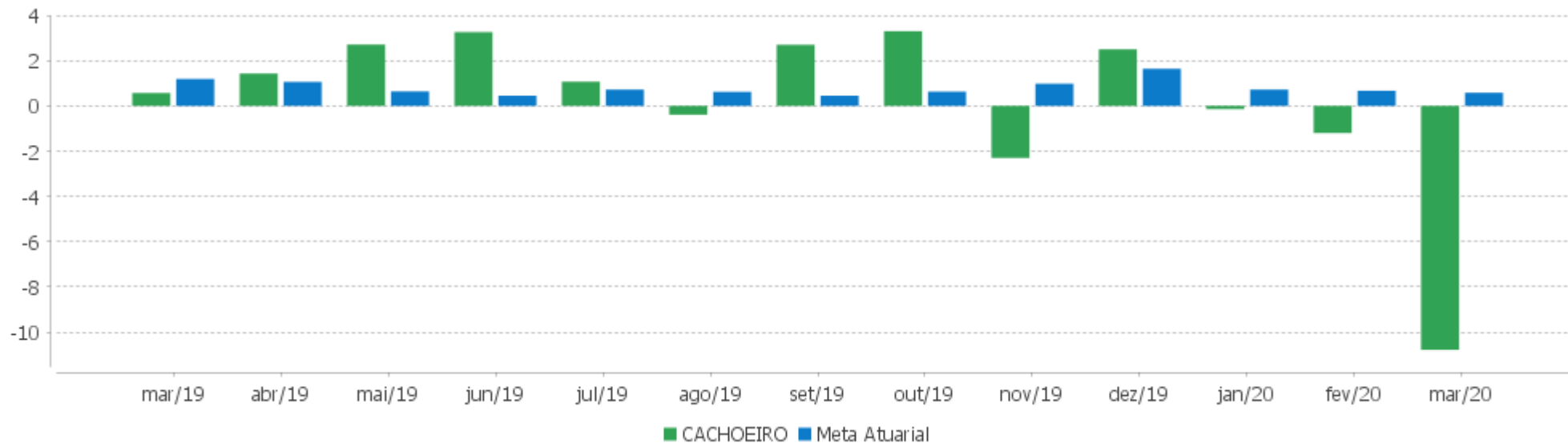
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	8	53,33	03 meses	-11,98	1,95	-13,93	25,25
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	46,67	06 meses	-8,95	5,30	-14,24	18,08
			12 meses	1,26	9,52	-8,25	13,01
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,30	2019-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,78	2020-03	Desde 31/12/2018	5,67	12,75	-7,08	11,82

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.	-14,39 -7,42	-15,15 -8,84	-15,15 -8,84	-13,83 -10,19	3,17 -5,97	18,66 -5,44	21,15 -16,27
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,00 -0,03	-6,38 -0,07	-6,38 -0,07	-3,82 -0,18	8,70 -0,44	23,48 -0,62	36,30 -1,12
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-13,12 -6,15	-12,58 -6,27	-12,58 -6,27	-10,06 -6,42	6,89 -2,25	23,16 -0,94	35,15 -2,28
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,34 5,63	-0,74 5,57	-0,74 5,57	1,66 5,30	6,93 -2,21	16,97 -7,14	29,44 -7,98
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,66 -0,45	-0,66 -0,66	-0,66 -0,66	1,94 -0,52	7,78 -1,34	17,10 -2,04	30,56 -3,36
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,45 -0,24	-0,41 -0,41	-0,41 -0,41	1,98 -0,48	8,03 -1,08	17,44 -1,70	30,97 -2,96
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,79 -0,04	-0,60 -0,03	-0,60 -0,03	1,92 -0,11	9,12 -0,21	18,91 -0,48	32,93 -0,74
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,98 -0,01	-6,33 -0,02	-6,33 -0,02	-3,73 -0,09	8,93 -0,22	23,52 -0,58	36,42 -1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	-1,71 -2,40	-0,75 -2,74	-0,75 -2,74	1,75 -3,64	8,65 -0,91	28,74 7,24	40,59 9,94
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,91 0,02	-10,68 -0,07	-10,68 -0,07	-8,13 -0,22	7,75 -0,49	25,87 -1,08	38,51 -1,44
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,89 0,04	-10,58 0,04	-10,58 0,04	-7,80 0,11	8,16 -0,07	26,53 -0,41	38,86 -1,08
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CREDITO PRIVAD Var. IPCA + 6% p.p.	-2,91 -3,49	-1,40 -3,38	-1,40 -3,38	1,20 -4,13	11,23 1,68	21,29 -0,09	31,27 -0,69
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	-0,03 -9,77	0,59 58,36	0,59 58,36	1,74 76,63	4,81 88,50	11,34 93,51	20,78 96,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 42,04	0,79 77,94	0,79 77,94	1,91 84,42	4,99 91,77	11,48 94,69	20,75 96,38
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	-28,86	-35,80	-35,80	-29,59	-22,92	-15,19	7,79

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.	1,05	1,05	1,05	0,69	0,55	-0,73	-4,57
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-29,37 0,54	-36,43 0,43	-36,43 0,43	-29,95 0,34	-23,37 0,10	-14,82 -0,36	11,01 -1,35
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,44 -1,02	-1,30 -3,29	-1,30 -3,29	-2,65 -7,98	-67,78 -77,33	-68,20 -89,58	-63,14 -95,11
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-31,64 -6,11	-35,22 -3,98	-35,22 -3,98	-28,77 -7,35	-13,41 -5,64	-0,89 -5,77	26,00 -1,17
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT Var. IBOVESPA p.p.	-35,06 -5,15	-40,34 -3,49	-40,34 -3,49	-28,21 2,08	-13,79 9,68	-6,52 7,94	25,26 12,89
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-30,90 -5,37	-36,49 -5,25	-36,49 -5,25	-25,03 -3,61	-13,17 -5,40	-6,42 -11,29	7,41 -19,76
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-27,40 -1,87	-30,98 0,25	-30,98 0,25	-22,11 -0,69	-12,36 -4,59	1,73 -3,15	28,59 1,41
BB ACOES ALO ETF % do CDI	-30,73 -9.080,99	-36,99 -3.655,18	-36,99 -3.655,18	-29,34 -1.296,07	-22,38 -411,71	-12,08 -99,66	14,56 67,64
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT Var. IBOVESPA p.p.	0,57 30,48	1,16 38,02	1,16 38,02	2,71 33,00	7,54 31,01		
CXCE11B Var. IBOVESPA p.p.	-16,65 13,25	-23,47 13,39	-23,47 13,39	-8,33 21,96	-2,72 20,75	-2,68 11,78	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,30 36,21	6,80 43,65	6,80 43,65	12,71 43,00	27,06 50,53	62,46 76,92	91,78 79,42
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

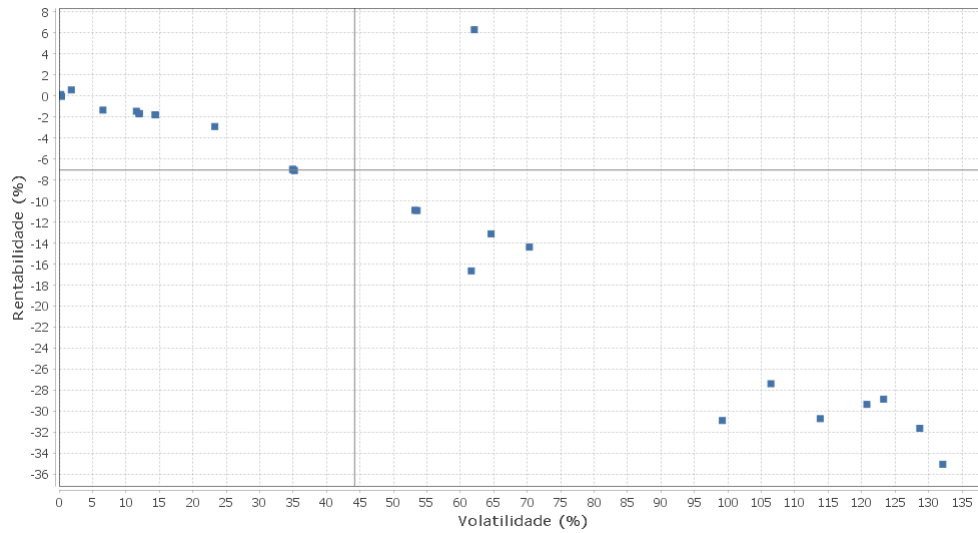
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.600.323,32	0,00	707.425,51364000	2,2621792530
03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,00	300.000,00	133.007,96637500	2,2555040000
03/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	57.869,91	0,00	15.742,60059800	3,6760070000
05/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	62.000,00	0,00	16.861,20967200	3,6770790000
05/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.821,51	0,00	31.226,28314400	3,6770790000
05/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	57.869,91	15.738,01047100	3,6770790000
06/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.065,67	3.121,52141600	2,2635340460
09/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.834,41213000	2,2638744610
16/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.188.054,64	1.407.323,95892100	2,2653310350
16/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.011,74	4.860,98492000	2,2653310350
16/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	621.212,52	168.793,71313800	3,6803060000
17/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	16.000,00	0,00	7.061,84946300	2,2656954220
17/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.240,96774400	2,2656954220
17/03/2020	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	3.091.875,07	0,00	550.167,46432600	5,6198798920
17/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.114,28	0,00	9.760,48227100	2,2656954220
17/03/2020	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	561.571,23	0,00	449.718,57514500	1,2487170000
18/03/2020	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	96.179,57	0,00	19.075,50652000	5,0420454050
18/03/2020	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	62.218,02	0,00	58.530,48253900	1,0630020000
25/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500.000,00	220.894,04728300	2,2635286290
25/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.835,76189100	2,2635286290
25/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.253,64283700	2,2635286290
25/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.821,51	0,00	31.186,00597300	3,6818280000
30/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	150.000,00	66.330,35009400	2,2614082360

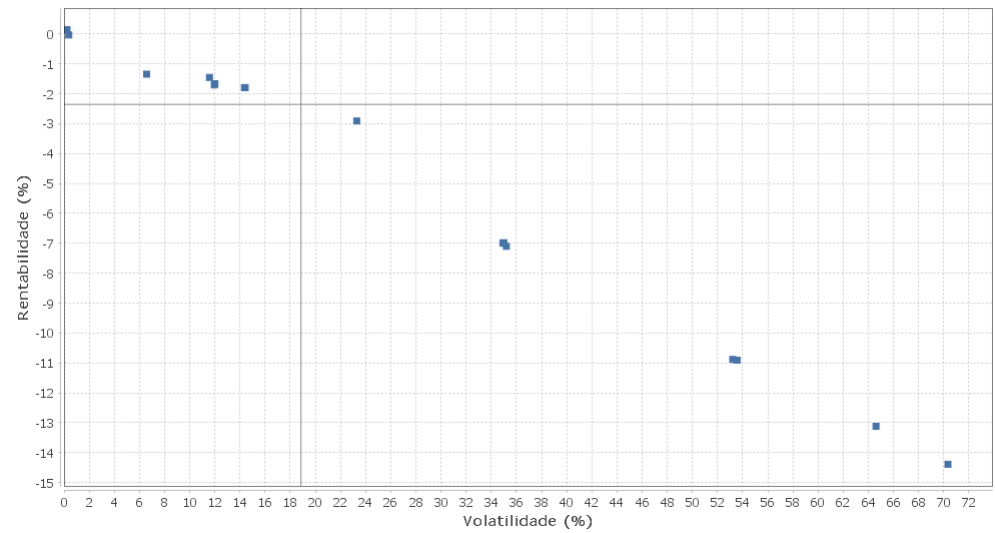
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

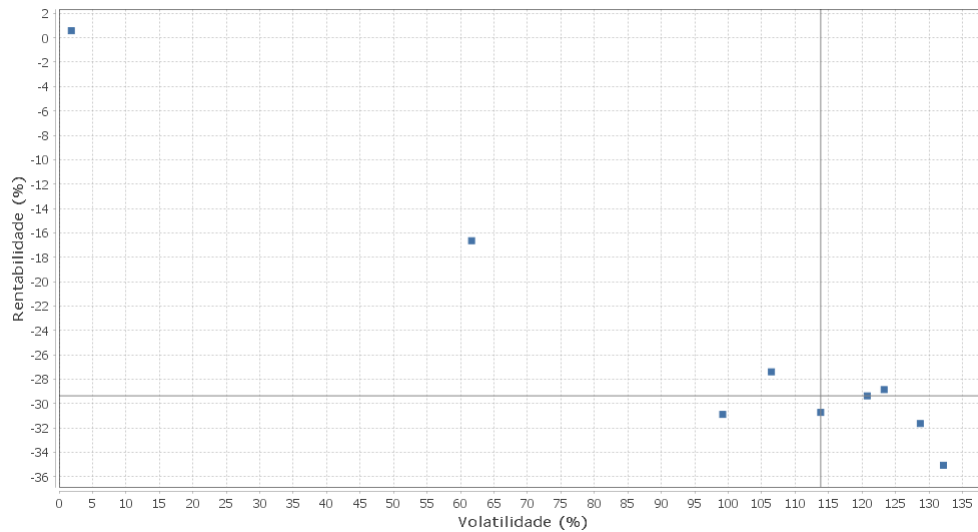
CACHOEIRO - No Mês



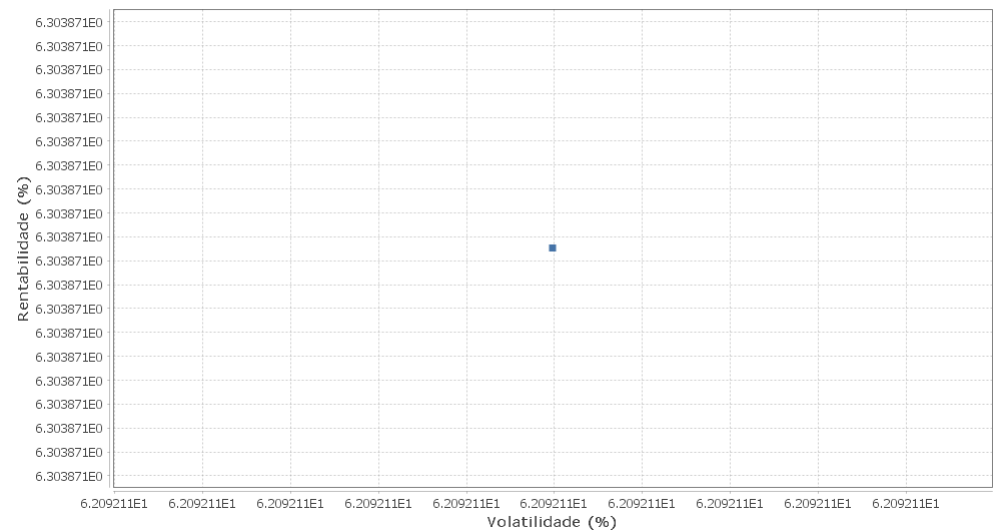
Renda Fixa - No Mês



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	0,24	0,03	0,14	2.510.279,11	1,00
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	-0,03	247.523,96	0,10
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT	Artigo 8º III	1,84	0,22	0,57	467.696,55	0,19
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	6,57	0,62	-1,34	2.688.429,15	1,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,13	-1,45	2.488.295,49	0,99
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,96	1,16	-1,71	521.942,42	0,21
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	12,01	1,17	-1,66	3.358.036,64	1,34
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	14,36	1,41	-1,79	14.499.998,82	5,78
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	10.797.716,48	4,31
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CREDITO PRIVAD	Artigo 7º VII, Alínea b	23,29	2,28	-2,91	1.718.240,00	0,69
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	34,92	3,29	-7,00	13.901.962,19	5,55
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	47.305.604,95	18,87
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	45.046.837,24	17,97
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	53,21	4,99	-10,89	5.332.537,58	2,13
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	53,55	5,02	-10,91	5.800.250,44	2,31
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	61,64	5,56	-16,65	4.304.940,00	1,72
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Artigo 9º A, III	62,09	6,71	6,30	7.925.386,89	3,16
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	64,61	6,05	-13,12	15.570.010,86	6,21
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	70,33	6,58	-14,39	35.084.706,49	14,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	99,17	8,60	-30,90	4.410.953,40	1,76
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	106,44	9,57	-27,40	5.710.310,79	2,28
BB ACOES ALO ETF	Artigo 8º II, Alínea b	113,81	10,12	-30,73	1.531.808,84	0,61
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	120,77	10,93	-29,37	3.948.310,83	1,58
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	123,29	11,23	-28,86	7.791.830,28	3,11
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	128,70	11,61	-31,64	2.773.027,90	1,11
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	Artigo 8º II, Alínea a	132,15	11,73	-35,06	4.523.713,11	1,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de março de 2020, observar que o percentual alocado no Artigo 8, Inciso III (0,19% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.