



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
OUTUBRO 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 17.11.2020.

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 84,05%

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 | 26,04 | 0,46 | -8,91 | 36.794.841,70 | 12,94 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 26,04 | 0,46 | -8,91 | 36.794.841,70 | 12,94 |

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 | 23,41 | 0,92 | -9,01 | 16.205.596,88 | 5,70 | 273.991.442,96 | 5,91 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 12,77 | 0,20 | -0,73 | 50.133.643,23 | 17,63 | 5.529.359.748,67 | 0,91 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 12,83 | 0,19 | -0,81 | 47.771.170,80 | 16,80 | 5.818.645.931,87 | 0,82 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,03 | 0,18 | 4,48 | 7.272.347,78 | 2,56 | 18.309.382.329,52 | 0,04 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 4,19 | 0,33 | 4,89 | 3.545.739,81 | 1,25 | 7.253.634.171,13 | 0,05 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | 19,71 | 0,20 | -4,62 | 5.687.528,30 | 2,00 | 1.936.566.655,94 | 0,29 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,82 | 0,22 | -4,61 | 6.194.470,40 | 2,18 | 1.789.450.540,00 | 0,35 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,13 | 0,15 | 5,00 | 2.623.322,65 | 0,92 | 9.550.097.040,26 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 5,00 | 0,19 | 4,50 | 11.178.312,29 | 3,93 | 4.413.688.996,03 | 0,25 |
| BB | BB | BB PREV RF VII | 2,40 | 0,49 | 3,15 | 966.825,35 | 0,34 | 240.126.324,03 | 0,40 |
| BB | BB | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 4,18 | 0,29 | 3,88 | 344.951,56 | 0,12 | 571.777.072,59 | 0,06 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 10,40 | 0,28 | -0,87 | 151.923.909,05 | 53,42 | | |

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 | 12,75 | 0,20 | -0,79 | 14.732.053,71 | 5,18 | 2.817.438.384,20 | 0,52 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 12,75 | 0,20 | -0,79 | 14.732.053,71 | 5,18 | | |

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 | 0,36 | 0,12 | 1,89 | 10.614.102,03 | 3,73 | 4.647.429.126,31 | 0,23 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,23 | 0,16 | 1,98 | 22.330.850,10 | 7,85 | 2.401.972.433,04 | 0,93 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI | 0,93 | 0,03 | 1,59 | 825.552,45 | 0,29 | 2.005.878.357,97 | 0,04 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,27 | 0,14 | 2,03 | 33.770.504,58 | 11,87 | | |

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 | 8,24 | -0,13 | 4,45 | 1.820.139,00 | 0,64 | 191.198.897,30 | 0,95 |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b | | | 8,24 | -0,13 | 4,45 | 1.820.139,00 | 0,64 | | |

| | | | | | | | | | |
|-------------------|--|--|--------------|-------------|--------------|-----------------------|--------------|--|--|
| Renda Fixa | | | 12,46 | 0,28 | -2,29 | 239.041.448,04 | 84,05 | | |
|-------------------|--|--|--------------|-------------|--------------|-----------------------|--------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,95%

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 | 43,93 | -0,76 | -16,37 | 10.151.104,20 | 3,57 | 161.160.215,25 | 6,30 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA | 43,53 | -0,80 | -18,74 | 5.047.287,13 | 1,77 | 109.890.635,80 | 4,59 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 43,60 | -0,77 | -17,11 | 15.198.391,33 | 5,34 | | |

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 | 38,50 | 1,43 | -24,65 | 5.651.173,39 | 1,99 | 112.779.074,68 | 5,01 |
| VINCI | CEF | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 39,50 | 0,05 | -17,54 | 6.822.609,00 | 2,40 | 793.160.820,76 | 0,86 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 48,35 | -2,40 | -26,75 | 5.893.013,66 | 2,07 | 1.154.693.546,75 | 0,51 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 45,61 | -1,72 | -5,70 | 4.036.511,27 | 1,42 | 158.100.669,26 | 2,55 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 41,61 | -0,59 | -18,02 | 22.403.307,32 | 7,88 | | |

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 | 41,41 | -0,68 | -18,46 | 1.982.522,97 | 0,70 | 164.498.606,35 | 1,21 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea b | | | 41,41 | -0,68 | -18,46 | 1.982.522,97 | 0,70 | | |

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 MULTIMERCADO | 0,90 | -0,24 | 1,17 | 0,00 | 0,00 | | |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 0,90 | -0,24 | 1,17 | 0,00 | 0,00 | | |

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 | 8,62 | 4,65 | -6,12 | 374.913,02 | 0,13 | 20.172.858,73 | 1,86 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a | | | 8,62 | 4,65 | -6,12 | 374.913,02 | 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 | 41,25 | 7,09 | 69,74 | 5.392.500,00 | 1,90 | 147.512.832,39 | 3,66 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b | | | 41,25 | 7,09 | 0,66 | 5.392.500,00 | 1,90 | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 38,62 | 0,19 | -15,41 | 45.351.634,64 | 15,95 | | |
| Total | | | 15,11 | 0,27 | -4,12 | 284.393.082,68 | 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 | 36.794.841,70 | 12,94 | 10,00 | 30,00 | 70,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 151.923.909,05 | 53,42 | 20,00 | 30,00 | 80,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa Referenciados | 14.732.053,71 | 5,18 | 0,00 | 5,00 | 30,00 | 70,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 33.770.504,58 | 11,87 | 1,00 | 4,00 | 30,00 | 50,00 |
| Artigo 7º VII, Alínea b | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado" | 1.820.139,00 | 0,64 | 0,00 | 1,00 | 2,00 | 15,00 |
| | Total Renda Fixa | 239.041.448,04 | 84,05 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 15.198.391,33 | 5,34 | 1,00 | 10,00 | 10,00 | 40,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 22.403.307,32 | 7,88 | 2,00 | 15,00 | 20,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea b | Fundos de Índice de Ações | 1.982.522,97 | 0,70 | 0,00 | 0,00 | 10,00 | 30,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 0,00 | 0,00 | 1,00 | 0,00 | 5,00 | 10,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea a | Fundos de Participações | 374.913,02 | 0,13 | 0,00 | 0,00 | 2,00 | 5,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea b | Fundos de Investimentos Imobiliários | 5.392.500,00 | 1,90 | 1,00 | 2,00 | 4,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 45.351.634,64 | 15,95 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

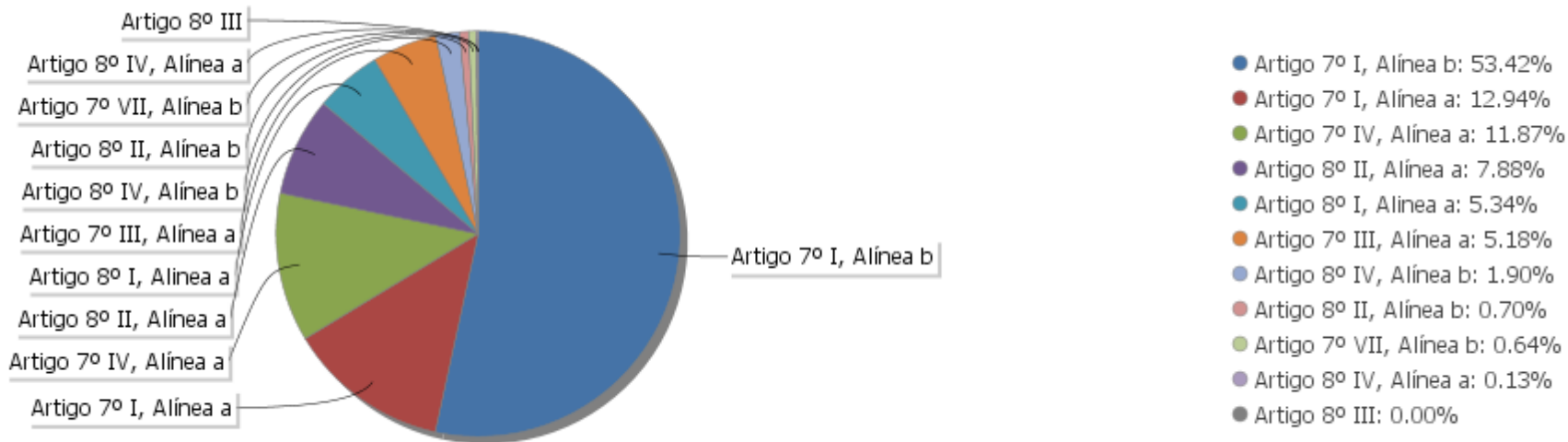
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|-----------------|------------------|--------------------|-----------------|-------------------|-------------|----------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 0,46 294,13 | -8,91 -365,86 | -8,02 -1.688,93 | 4,66 415,58 | -13,01 -405,19 | 169.098,20 | -3.743.770,60 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,28 175,68 | -0,87 -35,80 | -3,24 -683,66 | 4,39 391,47 | -1,20 -37,32 | 417.806,11 | -1.473.213,37 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 0,20 124,50 | -0,79 -32,45 | -3,17 -668,25 | 4,66 415,96 | -1,37 -42,81 | 28.735,25 | -117.386,96 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,14 91,92 | 2,03 83,23 | 0,34 71,46 | 1,16 103,80 | 2,72 84,57 | 48.634,65 | 328.920,19 |
| Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI | -0,13 -82,53 | 4,45 182,48 | -0,97 -205,07 | 5,02 447,22 | 4,80 149,61 | -2.361,00 | 77.463,00 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -0,77 -0,09 | -17,11 1,65 | -8,33 0,38 | 16,54 -0,16 | -11,03 1,35 | -118.535,28 | -1.666.318,70 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -0,59 0,10 | -18,02 0,73 | -6,85 1,85 | 16,69 -0,02 | -11,04 1,34 | -132.823,84 | -5.237.640,79 |
| Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | -0,68 0,01 | -18,46 0,30 | -7,36 1,35 | 16,51 -0,19 | -10,25 2,12 | -13.484,76 | -448.688,34 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | -0,24 0,44 | 1,17 19,92 | -0,67 8,04 | -0,24 -16,94 | 2,36 14,74 | -1.146,58 | 5.394,61 |
| Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 4,65 5,33 | -6,12 12,64 | 3,75 12,46 | -4,32 -21,02 | -7,00 5,38 | 16.643,53 | -24.437,41 |
| Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | 7,09 7,78 | 0,66 19,42 | 10,50 19,21 | 18,48 1,78 | 18,96 31,33 | 357.520,03 | 13.268,94 |
| Artigo 9º A, III % do CDI | 0,00 0,00 | 5,29 217,06 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 12,66 394,35 | 0,00 | 370.875,59 |
| | | | | | | 770.086,31 | -11.915.533,84 |

Análise de Liquidez

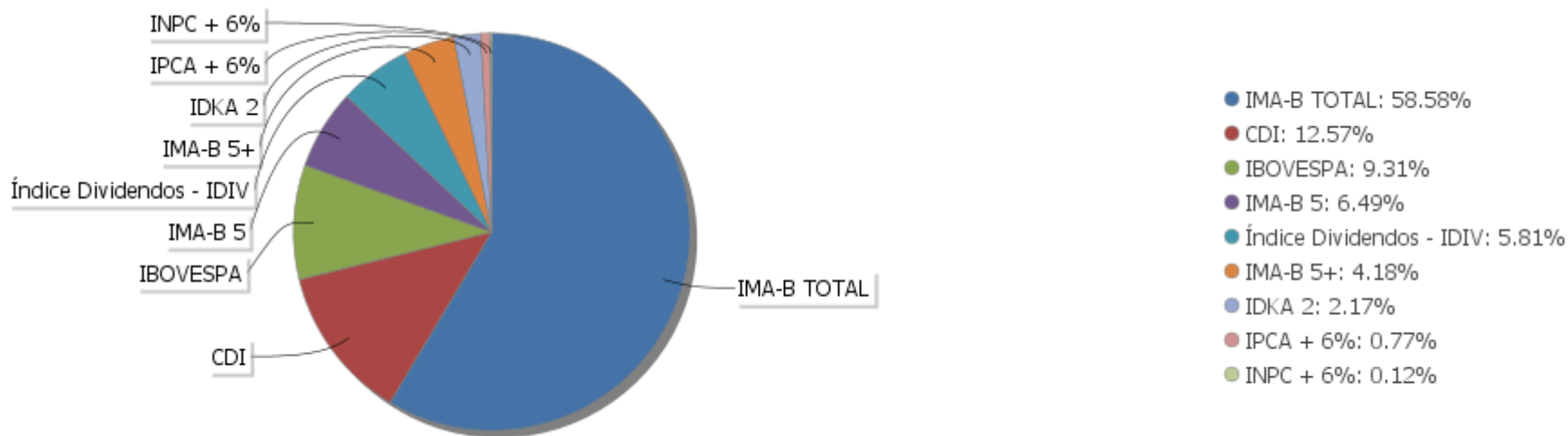
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 235.427.343,80 | 82,78 | 235.427.343,80 | 82,78 |
| de 31 a 364 dias | 10.859.120,27 | 3,82 | 246.286.464,07 | 86,60 |
| acima de 365 dias | 38.106.618,61 | 13,40 | 284.393.082,68 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

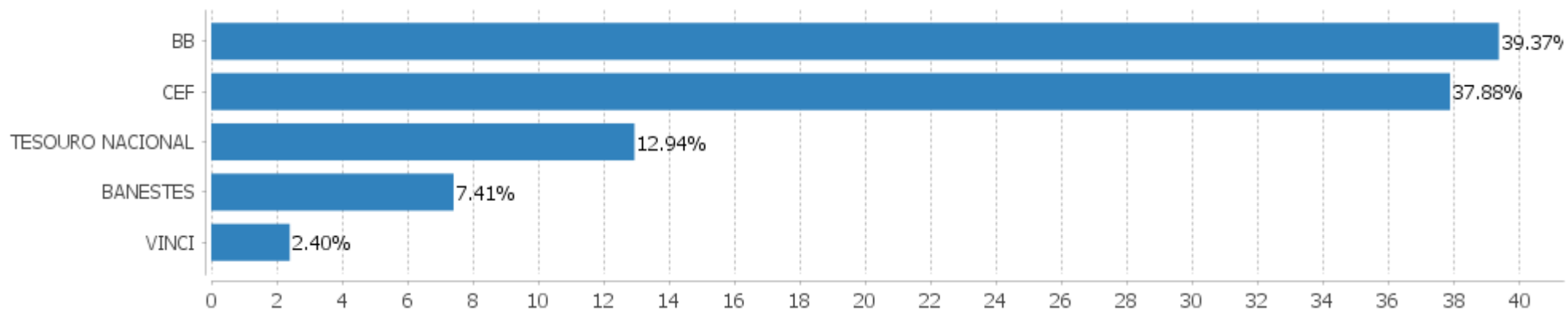


Alocação Por Estratégia



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 | -2,14 | -2,05 | 0,27 | | | -4,12 |
| IPCA + 5,86% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,88 | 0,72 | 1,12 | 1,34 | | | 7,16 |
| p.p. indexador | -0,85 | -1,86 | -11,35 | 2,48 | 1,98 | 2,24 | 4,21 | -2,85 | -3,17 | -1,07 | | | -11,28 |
| 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 |

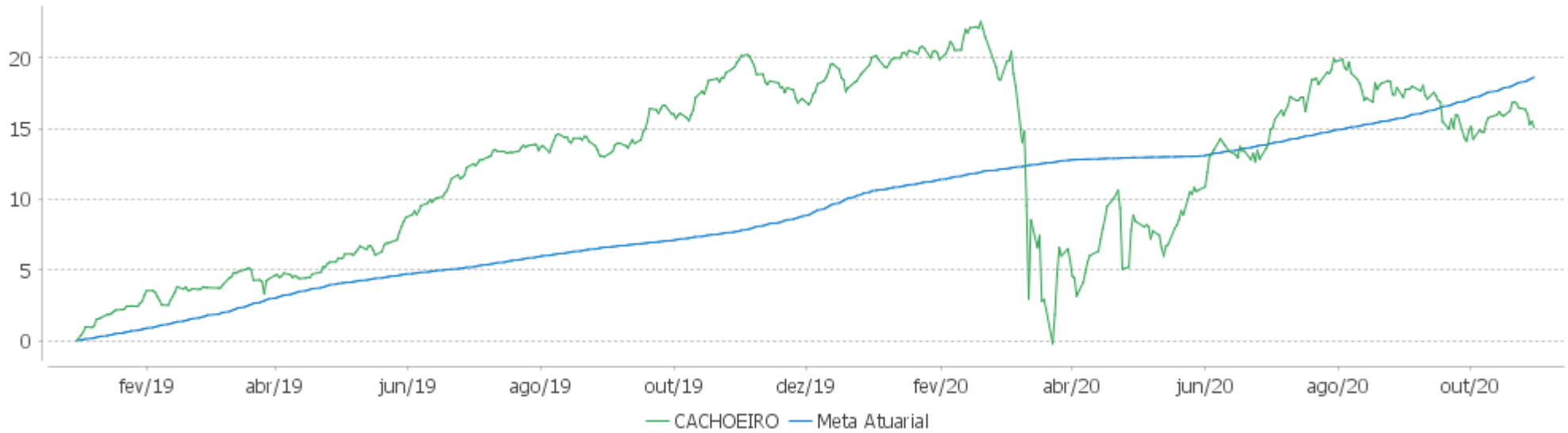
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

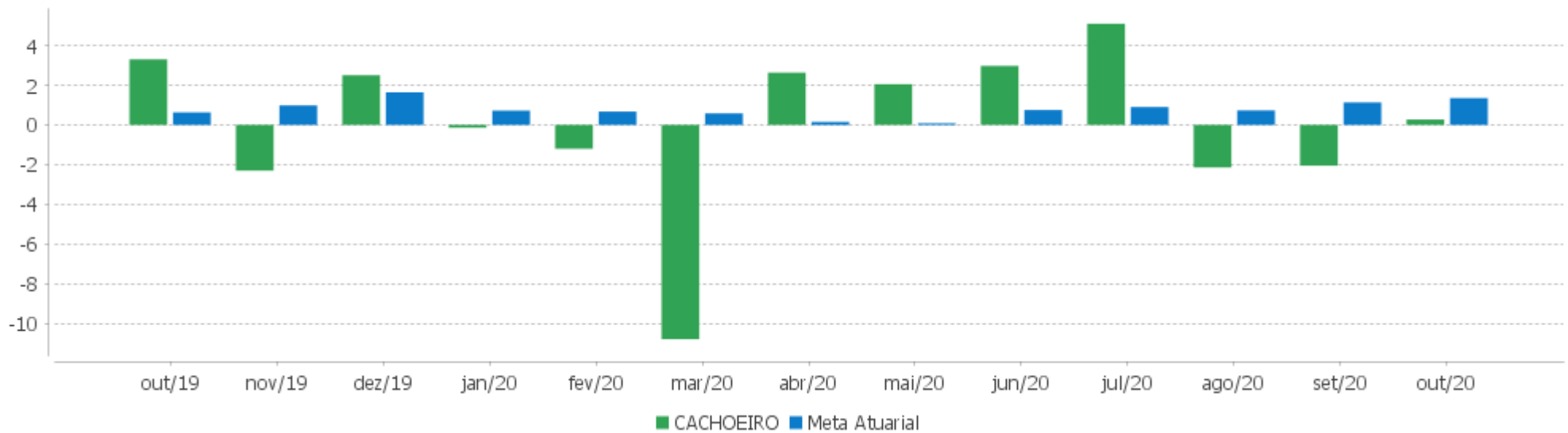
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 12 | 54,55 | 03 meses | -3,88 | 3,21 | -7,09 | 7,33 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 10 | 45,45 | 06 meses | 6,15 | 4,96 | 1,18 | 8,07 |
| | | | 12 meses | -3,98 | 9,98 | -13,97 | 15,11 |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,09 | 2020-07 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -10,78 | 2020-03 | Desde 31/12/2018 | 15,10 | 18,51 | -3,40 | 11,42 |

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,19 -0,02 | -0,81 -0,30 | -3,15 -0,07 | 4,68 -0,13 | -1,41 -0,40 | 24,69 -0,78 | 37,24 -1,15 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,92 0,70 | -9,01 -8,50 | -7,58 -4,50 | 2,35 -2,47 | -10,73 -9,72 | 23,19 -2,27 | 34,63 -3,75 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,18 -0,02 | 4,48 -0,24 | 0,41 -0,09 | 4,66 -0,15 | 5,38 -0,33 | 19,69 -0,58 | 30,54 -0,92 |
| BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,49 0,28 | 3,15 3,66 | 1,16 4,23 | 3,77 -1,05 | 4,54 5,55 | 15,45 -10,01 | 26,10 -12,29 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 0,33 0,29 | 4,89 -0,56 | 1,13 0,04 | 5,25 0,40 | 6,32 -0,41 | 18,19 -1,41 | 28,86 -2,40 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,19 -0,01 | 4,50 -0,22 | 0,40 -0,10 | 4,62 -0,19 | 5,42 -0,29 | 19,71 -0,56 | 30,59 -0,88 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,15 0,12 | 5,00 -0,45 | 0,98 -0,11 | 4,98 0,13 | 6,16 -0,57 | 18,25 -1,35 | 29,01 -2,25 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,20 -0,02 | -0,73 -0,23 | -3,19 -0,11 | 4,62 -0,19 | -1,29 -0,28 | 24,83 -0,64 | 37,31 -1,07 |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p. | 0,29 -1,09 | 3,88 -4,17 | 0,61 -3,03 | 4,32 -1,37 | 4,97 -6,04 | 18,91 -1,76 | 40,24 7,26 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | 0,22 -0,00 | -4,61 -0,27 | -5,99 -0,06 | 4,76 -0,14 | -6,25 -0,40 | 27,85 -1,13 | 41,32 -1,69 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p. | 0,20 -0,02 | -4,62 -0,28 | -6,05 -0,12 | 4,65 -0,25 | -6,05 -0,20 | 28,32 -0,66 | 41,82 -1,20 |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI | 0,03 20,33 | -0,37 -14,99 | 0,58 122,66 | 1,91 170,58 | 0,30 9,36 | 6,81 70,85 | 14,35 85,48 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,16 101,53 | 1,98 81,34 | 0,36 76,91 | 1,12 100,00 | 2,69 83,84 | 8,87 92,26 | 15,98 95,19 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,12 76,62 | 1,89 77,49 | 0,26 55,37 | 1,09 96,90 | 2,56 79,77 | 8,75 91,05 | 15,66 93,26 |
| FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p. | -0,13 -1,48 | 4,45 -2,83 | -0,97 -4,22 | 5,02 -0,02 | 4,80 -5,30 | 23,24 3,57 | 32,06 -0,50 |
| NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,46 0,25 | -8,91 -8,40 | -8,02 -4,94 | 4,66 -0,15 | -12,51 -11,51 | 23,50 -1,97 | 29,88 -8,50 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 0,20 | -0,79 | -3,17 | 4,66 | -1,37 | 24,61 | 37,33 |

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 | -0,28 | -0,09 | -0,15 | -0,37 | -0,86 | -1,06 |
| CXCE11B Var. IBOVESPA p.p. | 7,09 7,78 | 69,74 88,50 | 10,50 19,21 | 68,52 51,82 | 97,91 110,29 | 596,00 588,53 | 3.363,75 3.337,32 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p. | | | | | | | |
| FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p. | 4,65 3,29 | -6,12 -13,40 | 3,75 0,51 | -4,32 -9,35 | -7,00 -17,10 | -69,52 -89,19 | -69,86 -102,42 |
| BB ACOES ALO ETF % do CDI | -0,68 -430,39 | -18,46 -757,62 | -7,36 -1.550,49 | 16,51 1.472,25 | -10,25 -319,31 | 10,72 111,44 | 29,98 178,56 |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -1,72 -2,37 | -5,70 14,86 | -5,04 3,60 | 20,85 9,52 | 1,31 11,89 | 39,71 15,21 | 62,86 31,90 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p. | -2,40 -1,72 | -22,29 -3,53 | -9,46 -0,75 | 17,01 0,31 | -8,36 4,01 | 26,57 19,10 | 31,88 5,45 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 1,43 0,78 | -18,63 1,93 | -3,15 5,49 | 17,44 6,11 | -6,38 4,20 | 27,09 2,59 | 23,33 -7,63 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 0,05 -0,60 | -17,54 3,02 | -8,51 0,13 | 11,41 0,08 | -10,04 0,54 | 27,58 3,08 | 34,92 3,96 |
| BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p. | -0,76 -0,07 | -16,37 2,39 | -8,18 0,53 | 16,71 0,01 | -10,50 1,87 | 8,33 0,86 | 26,23 -0,20 |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p. | -0,80 -0,11 | -18,74 0,02 | -8,63 0,07 | 16,20 -0,50 | -12,40 -0,02 | 6,68 -0,79 | 24,45 -1,98 |
| CDI | 0,16 | 2,44 | 0,47 | 1,12 | 3,21 | 9,62 | 16,79 |
| IBOVESPA | -0,69 | -18,76 | -8,71 | 16,70 | -12,37 | 7,47 | 26,44 |
| INPC + 6% | 1,38 | 8,05 | 3,63 | 5,69 | 11,01 | 20,67 | 32,97 |
| IPCA + 6% | 1,35 | 7,28 | 3,24 | 5,03 | 10,10 | 19,67 | 32,57 |

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 | 0,16 | 3,29 | 0,43 | 1,38 | 4,06 | 11,49 | 19,36 |
| IRF-M 1+ | -0,61 | 4,76 | -2,63 | 1,75 | 4,63 | 23,41 | 36,20 |
| IRF-M TOTAL | -0,33 | 4,27 | -1,63 | 1,64 | 4,44 | 19,78 | 31,08 |
| IMA-B 5 | 0,20 | 4,72 | 0,50 | 4,81 | 5,71 | 20,28 | 31,47 |
| IMA-B 5+ | 0,22 | -4,35 | -5,92 | 4,90 | -5,85 | 28,98 | 43,02 |
| IMA-B TOTAL | 0,21 | -0,51 | -3,08 | 4,81 | -1,00 | 25,47 | 38,38 |
| IMA-C TOTAL | 2,81 | 21,09 | 8,08 | 19,98 | 20,18 | 45,58 | 72,54 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | -0,00 | 1,96 | -1,39 | 2,13 | 2,16 | 17,10 | 27,20 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,09 | 2,49 | -1,11 | 2,64 | 2,67 | 17,87 | 28,36 |
| IDKA 2 | 0,04 | 5,45 | 1,09 | 4,85 | 6,73 | 19,60 | 31,26 |
| IDKA 20 | 0,68 | -11,22 | -9,64 | 5,97 | -13,27 | 34,55 | 50,97 |
| CDI | 0,16 | 2,44 | 0,47 | 1,12 | 3,21 | 9,62 | 16,79 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | -0,69 | -18,76 | -8,71 | 16,70 | -12,37 | 7,47 | 26,44 |
| IBRX 100 | -0,55 | -17,87 | -8,31 | 17,55 | -11,05 | 11,01 | 29,92 |
| IBRX 50 | -0,54 | -18,50 | -8,37 | 18,20 | -12,42 | 5,25 | 23,91 |
| SMALL CAP | -2,28 | -20,78 | -8,74 | 20,16 | -6,17 | 34,08 | 41,52 |
| IFIX | -1,01 | -13,47 | 1,23 | 6,27 | -0,90 | 23,38 | 24,28 |
| Índice Consumo - ICON | -2,86 | -11,86 | -8,08 | 17,23 | -1,94 | 42,20 | 27,52 |
| Índice Dividendos - IDIV | 0,65 | -20,56 | -8,64 | 11,34 | -10,58 | 24,50 | 30,96 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,86 | 2,22 | 1,75 | 1,99 | 3,92 | 6,55 | 11,41 |
| INPC | 0,89 | 2,95 | 2,13 | 2,63 | 4,77 | 7,45 | 11,75 |
| IGPM | 3,23 | 18,10 | 10,67 | 15,22 | 20,93 | 24,74 | 38,21 |
| SELIC | 0,16 | 2,44 | 0,47 | 1,12 | 3,21 | 9,62 | 16,80 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

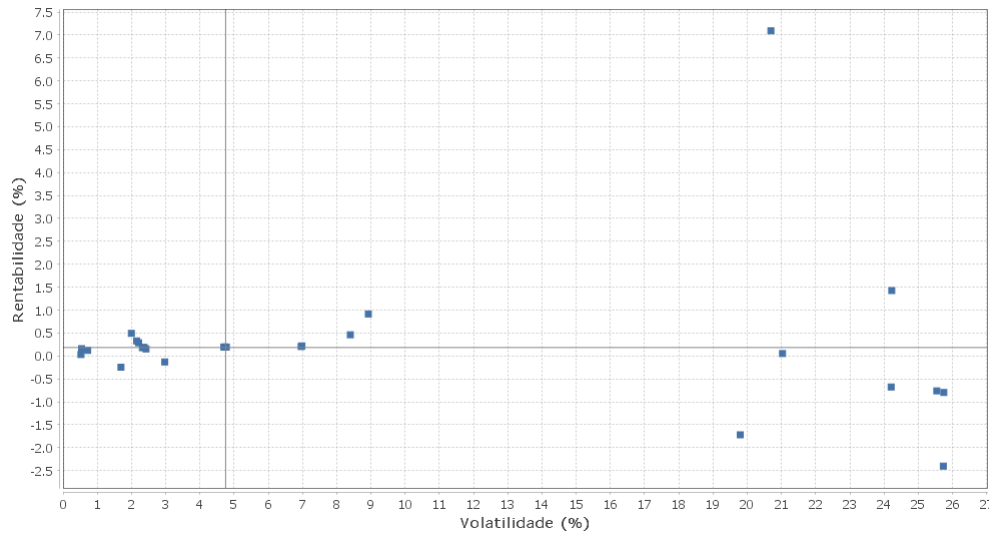
Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|--|--------------|------------|------------------|------------------|
| 147 | 01/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 60.000,00 | 26.226,38378900 | 2,2877725150 |
| 148 | 01/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.822.940,37 | 0,00 | 796.818,89613000 | 2,2877725150 |
| 149 | 02/10/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 114.821,51 | 0,00 | 30.943,51414200 | 3,7106810000 |
| 150 | 05/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 400.000,00 | 175.020,52136400 | 2,2854462830 |
| 151 | 05/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 90.000,00 | 0,00 | 39.379,61730600 | 2,2854462830 |
| 152 | 05/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 50.000,00 | 21.877,56517000 | 2,2854462830 |
| 153 | 09/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 22.114,28 | 0,00 | 9.659,79702800 | 2,2893110420 |
| 154 | 09/10/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 97.000,00 | 0,00 | 26.103,66005600 | 3,7159540000 |
| 155 | 15/10/2020 | FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO | 0,00 | 467.728,21 | 399,70849503 | 1.170,1733033300 |
| 156 | 16/10/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 514.000,00 | 0,00 | 138.238,00334800 | 3,7182250000 |
| 157 | 19/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 30.000,00 | 13.092,76425800 | 2,2913419510 |
| 158 | 22/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 540.000,00 | 0,00 | 235.626,53956900 | 2,2917622140 |
| 159 | 26/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 600.000,00 | 261.790,75452400 | 2,2919067600 |
| 160 | 26/10/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 50.000,00 | 21.815,89621000 | 2,2919067600 |
| 161 | 29/10/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 114.821,51 | 0,00 | 30.864,31304900 | 3,7202030000 |

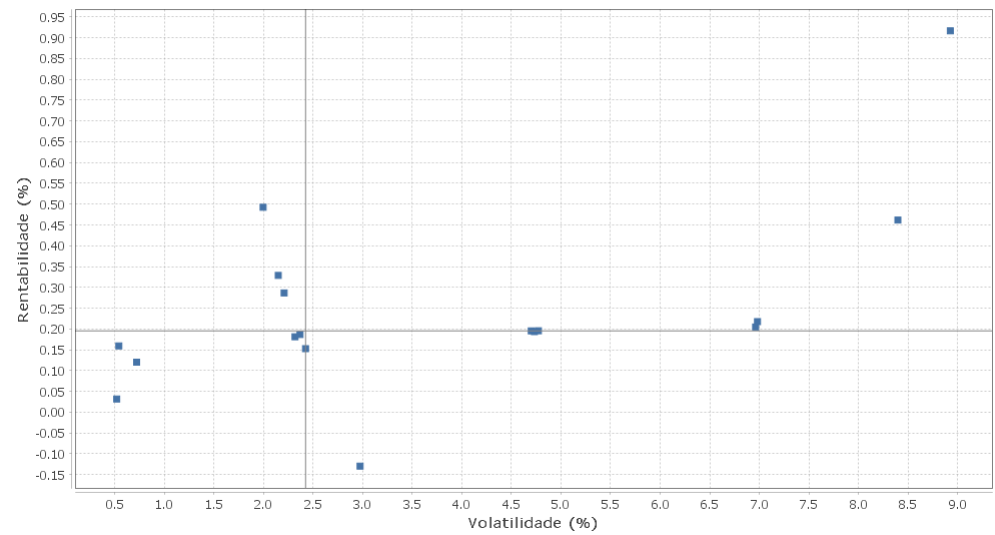
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

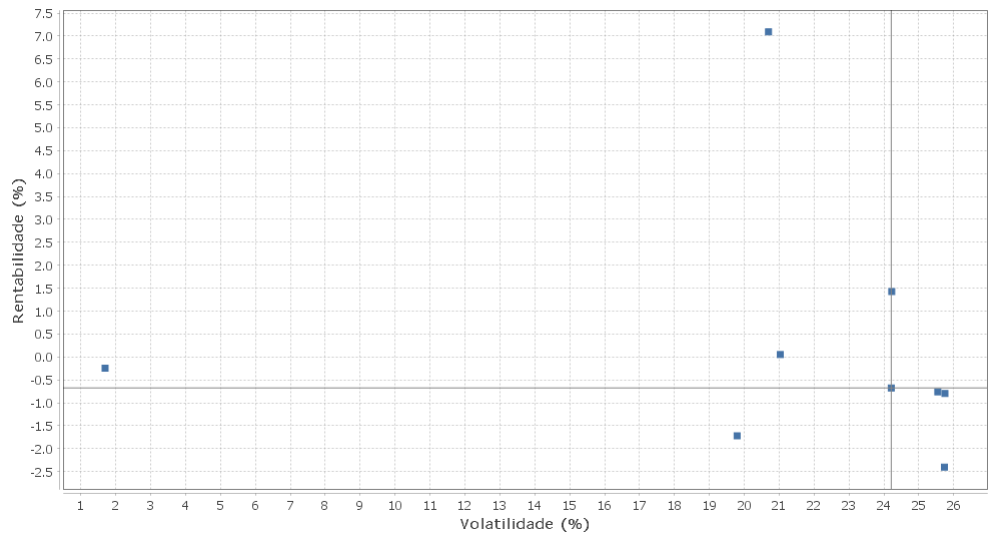
CACHOEIRO - No Mês



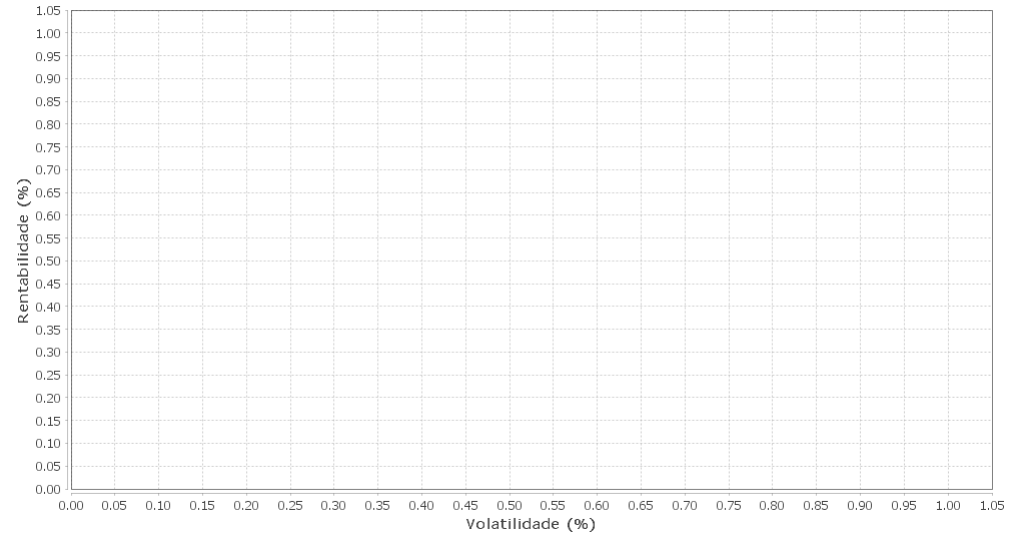
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-------------------------|--------------|-------|-------|--------|-------|---------------|------------|
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,52 | 0,12 | -0,00 | -0,24 | 0,03 | 825.552,45 | 0,29 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,54 | 0,10 | 0,00 | 0,00 | 0,16 | 22.330.850,10 | 7,85 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,72 | 0,13 | 0,00 | -0,05 | 0,12 | 10.614.102,03 | 3,73 |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO | Artigo 8º III | 1,69 | NaN | 0,00 | -0,24 | -0,24 | 0,00 | 0,00 |
| BB PREV RF VII | Artigo 7º I, Alínea b | 2,00 | 0,89 | 0,00 | 0,17 | 0,49 | 966.825,35 | 0,34 |
| BB PREV RF IDKA2 | Artigo 7º I, Alínea b | 2,15 | 0,90 | 0,01 | 0,08 | 0,33 | 3.545.739,81 | 1,25 |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,21 | 1,06 | 0,00 | 0,06 | 0,29 | 344.951,56 | 0,12 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,32 | 1,02 | 0,02 | 0,01 | 0,18 | 7.272.347,78 | 2,56 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,37 | 1,09 | 0,03 | 0,01 | 0,19 | 11.178.312,29 | 3,93 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,43 | 1,08 | 0,01 | -0,00 | 0,15 | 2.623.322,65 | 0,92 |
| FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF | Artigo 7º VII, Alínea b | 2,97 | 1,76 | 0,01 | -0,10 | -0,13 | 1.820.139,00 | 0,64 |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | Artigo 7º III, Alínea a | 4,70 | 3,15 | 0,15 | 0,01 | 0,20 | 14.732.053,71 | 5,18 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 4,73 | 3,16 | 0,50 | 0,01 | 0,19 | 47.771.170,80 | 16,80 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 4,77 | 3,15 | 0,52 | 0,01 | 0,20 | 50.133.643,23 | 17,63 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 6,96 | 4,93 | 0,09 | 0,01 | 0,20 | 5.687.528,30 | 2,00 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 6,98 | 4,93 | 0,10 | 0,01 | 0,22 | 6.194.470,40 | 2,18 |
| NTN-B 150555 | Artigo 7º I, Alínea a | 8,40 | 7,26 | 0,86 | 0,04 | 0,46 | 36.794.841,70 | 12,94 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B | Artigo 7º I, Alínea b | 8,93 | 5,38 | -0,01 | 0,09 | 0,92 | 16.205.596,88 | 5,70 |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | Artigo 8º II, Alínea a | 19,79 | 10,05 | 0,11 | -0,09 | -1,72 | 4.036.511,27 | 1,42 |
| CXCE11B | Artigo 8º IV, Alínea b | 20,69 | 2,39 | 0,00 | 0,34 | 7,09 | 5.392.500,00 | 1,90 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 21,03 | 9,83 | 0,19 | -0,00 | 0,05 | 6.822.609,00 | 2,40 |
| BB ACOES ALO ETF | Artigo 8º II, Alínea b | 24,21 | 10,48 | 0,06 | -0,03 | -0,68 | 1.982.522,97 | 0,70 |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI | Artigo 8º II, Alínea a | 24,22 | 10,94 | 0,17 | 0,05 | 1,43 | 5.651.173,39 | 1,99 |
| BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI | Artigo 8º I, Alínea a | 25,54 | 9,89 | 0,28 | -0,04 | -0,76 | 10.151.104,20 | 3,57 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 25,73 | 12,41 | 0,20 | -0,10 | -2,40 | 5.893.013,66 | 2,07 |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA | Artigo 8º I, Alínea a | 25,75 | 10,77 | 0,15 | -0,04 | -0,80 | 5.047.287,13 | 1,77 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de outubro de 2020, observar que;

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III (0,00% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.