



**LDB**  
EMPRESAS

**CACHOEIRO**  
SETEMBRO 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 20.10.2020.

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 83,77%

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   | 25,97               | -3,22           | -9,33           | 36.625.743,50        | 12,99        |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b> |                | <b>25,97</b>        | <b>-3,22</b>    | <b>-9,33</b>    | <b>36.625.743,50</b> | <b>12,99</b> |

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                 | 23,29               | -5,05           | -9,84           | 16.058.447,39         | 5,69         | 288.574.129,48    | 5,56    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI                | 12,72               | -1,56           | -0,93           | 50.035.670,18         | 17,74        | 5.533.318.681,28  | 0,90    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 12,79               | -1,53           | -1,00           | 47.678.899,96         | 16,91        | 5.834.527.804,73  | 0,82    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 5,01                | -0,16           | 4,29            | 7.259.191,24          | 2,57         | 17.747.142.317,32 | 0,04    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IDKA2                                    | 4,16                | 0,11            | 4,55            | 3.534.127,14          | 1,25         | 7.070.754.781,93  | 0,05    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI              | 19,64               | -2,65           | -4,82           | 5.675.903,35          | 2,01         | 1.936.096.946,75  | 0,29    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 19,74               | -2,64           | -4,82           | 6.181.005,84          | 2,19         | 1.755.979.575,38  | 0,35    |
| CEF                                    | CEF      | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 4,08                | 0,04            | 4,84            | 2.619.320,94          | 0,93         | 9.208.011.978,57  | 0,03    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                        | 4,98                | -0,15           | 4,30            | 11.157.484,53         | 3,96         | 4.406.252.863,92  | 0,25    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF VII                                      | 2,35                | 0,19            | 2,64            | 962.087,03            | 0,34         | 238.949.489,36    | 0,40    |
| BB                                     | BB       | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI             | 4,15                | -0,10           | 3,58            | 343.965,34            | 0,12         | 570.142.358,76    | 0,06    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |          |                                                     | <b>10,36</b>        | <b>-1,77</b>    | <b>-1,14</b>    | <b>151.506.102,94</b> | <b>53,72</b> |                   |         |

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 | 12,71               | -1,54           | -0,98           | 14.703.318,46        | 5,21        | 2.850.384.468,52 | 0,52    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |                                                   | <b>12,71</b>        | <b>-1,54</b>    | <b>-0,98</b>    | <b>14.703.318,46</b> | <b>5,21</b> |                  |         |

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                | -0,00           | 1,77            | 9.761.053,08         | 3,46         | 4.760.770.417,77 | 0,21    |
| BB                                      | BB       | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 0,17                | 0,02            | 1,82            | 21.009.830,03        | 7,45         | 2.533.726.732,47 | 0,83    |
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI       | 0,92                | 0,15            | 1,56            | 825.289,15           | 0,29         | 2.000.048.767,88 | 0,04    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |          |                                               | <b>0,21</b>         | <b>0,02</b>     | <b>1,88</b>     | <b>31.596.172,26</b> | <b>11,20</b> |                  |         |

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 | 8,22                | -0,63           | 4,58            | 1.822.500,00          | 0,65         | 186.232.441,88 | 0,98    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> |        |                             | <b>8,22</b>         | <b>-0,63</b>    | <b>4,58</b>     | <b>1.822.500,00</b>   | <b>0,65</b>  |                |         |
| <b>Renda Fixa</b>                        |        |                             | <b>12,42</b>        | <b>-1,74</b>    | <b>-2,56</b>    | <b>236.253.837,16</b> | <b>83,77</b> |                |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,23%

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 | 43,48               | -4,50           | -15,72          | 10.229.110,59        | 3,63        | 163.768.963,67 | 6,25    |
| CEF                                    | CEF    | FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA     | 43,08               | -4,69           | -18,09          | 5.087.816,02         | 1,80        | 110.541.465,03 | 4,60    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b> |        |                                   | <b>43,15</b>        | <b>-4,56</b>    | <b>-16,46</b>   | <b>15.316.926,61</b> | <b>5,43</b> |                |         |

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                     | 38,04               | -1,49           | -25,71          | 5.571.749,05         | 1,98        | 107.583.302,88   | 5,18    |
| VINCI                                   | CEF      | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS         | 39,13               | -4,93           | -17,58          | 6.819.071,87         | 2,42        | 783.577.685,83   | 0,87    |
| CEF                                     | CEF      | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                             | 47,79               | -5,93           | -24,94          | 6.038.152,62         | 2,14        | 1.156.431.775,09 | 0,52    |
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 45,33               | -2,96           | -4,05           | 4.107.157,62         | 1,46        | 157.034.448,33   | 2,62    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |          |                                                        | <b>41,19</b>        | <b>-4,02</b>    | <b>-17,54</b>   | <b>22.536.131,16</b> | <b>7,99</b> |                  |         |

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 | 40,96               | -4,48           | -17,90          | 1.996.007,73        | 0,71        | 166.544.151,67 | 1,20    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea b</b> |        |                  | <b>40,96</b>        | <b>-4,48</b>    | <b>-17,90</b>   | <b>1.996.007,73</b> | <b>0,71</b> |                |         |

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 | 1,73                | -0,45           | 1,41            | 468.874,79        | 0,17        | 505.717.833,93 | 0,09    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b> |        |                                          | <b>1,73</b>         | <b>-0,45</b>    | <b>1,41</b>     | <b>468.874,79</b> | <b>0,17</b> |                |         |

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 | 7,27                | -0,51           | -10,29          | 358.269,49            | 0,13          | 20.172.858,73  | 1,78    |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>                       |        |                                    | <b>7,27</b>         | <b>-0,51</b>    | <b>-10,29</b>   | <b>358.269,49</b>     | <b>0,13</b>   |                |         |
| 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                            | 25,98               | 1,06            | -9,68           | 5.081.000,00          | 1,80          | 147.512.832,39 | 3,44    |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>                       |        |                                    | <b>25,98</b>        | <b>1,06</b>     | <b>-6,01</b>    | <b>5.081.000,00</b>   | <b>1,80</b>   |                |         |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados                   |        |                                    | 38,21               | -3,62           | -15,57          | 45.757.209,78         | 16,23         |                |         |
| <b>Total</b>                                                  |        |                                    | <b>15,03</b>        | <b>-2,05</b>    | <b>-4,38</b>    | <b>282.011.046,94</b> | <b>100,00</b> |                |         |

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       |
| <b>Renda Fixa</b>                                  |                                                          |                       |              |                           |          |        |                    |
| Artigo 7º I, Alínea a                              | Títulos do Tesouro Nacional                              | 36.625.743,50         | 12,99        | 10,00                     | 30,00    | 70,00  | 100,00             |
| Artigo 7º I, Alínea b                              | Fundos 100% Títulos Públicos                             | 151.506.102,94        | 53,72        | 20,00                     | 30,00    | 80,00  | 100,00             |
| Artigo 7º III, Alínea a                            | Fundos Renda Fixa Referenciados                          | 14.703.318,46         | 5,21         | 0,00                      | 5,00     | 30,00  | 70,00              |
| Artigo 7º IV, Alínea a                             | Fundos de Renda Fixa                                     | 31.596.172,26         | 11,20        | 1,00                      | 4,00     | 30,00  | 50,00              |
| Artigo 7º VII, Alínea b                            | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"                      | 1.822.500,00          | 0,65         | 0,00                      | 1,00     | 2,00   | 15,00              |
|                                                    | <b>Total Renda Fixa</b>                                  | <b>236.253.837,16</b> | <b>83,77</b> |                           |          |        |                    |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |                                                          |                       |              |                           |          |        |                    |
| Artigo 8º I, Alínea a                              | Fundos de Ações Referenciados                            | 15.316.926,61         | 5,43         | 1,00                      | 10,00    | 10,00  | 40,00              |
| Artigo 8º II, Alínea a                             | Fundos de Ações                                          | 22.536.131,16         | 7,99         | 2,00                      | 15,00    | 20,00  | 30,00              |
| Artigo 8º II, Alínea b                             | Fundos de Índice de Ações                                | 1.996.007,73          | 0,71         | 0,00                      | 0,00     | 10,00  | 30,00              |
| Artigo 8º III                                      | Fundos Multimercados                                     | 468.874,79            | 0,17         | 1,00                      | 0,00     | 5,00   | 10,00              |
| Artigo 8º IV, Alínea a                             | Fundos de Participações                                  | 358.269,49            | 0,13         | 0,00                      | 0,00     | 2,00   | 5,00               |
| Artigo 8º IV, Alínea b                             | Fundos de Investimentos Imobiliários                     | 5.081.000,00          | 1,80         | 1,00                      | 2,00     | 4,00   | 10,00              |
|                                                    | <b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> | <b>45.757.209,78</b>  | <b>16,23</b> |                           |          |        |                    |

## 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<br>% do CDI            | -3,22<br>-2.051,32 | -9,33<br>-410,07 | 0,44<br>85,69  | 6,86<br>548,80   | -7,92<br>-223,50 | -1.218.579,72 | -3.912.868,80  |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | -1,77<br>-1.128,07 | -1,14<br>-50,30  | 0,63<br>123,85 | 5,34<br>427,25   | 1,50<br>42,44    | -2.731.136,58 | -1.891.019,48  |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | -1,54<br>-980,30   | -0,98<br>-43,25  | 0,89<br>173,47 | 5,76<br>460,90   | 1,73<br>48,71    | -229.789,89   | -146.122,21    |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 0,02<br>12,20      | 1,88<br>82,64    | 0,45<br>87,45  | 1,14<br>91,06    | 3,00<br>84,64    | 5.876,76      | 280.285,54     |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | -0,63<br>-401,29   | 4,58<br>201,30   | 1,00<br>194,38 | 6,07<br>485,17   | 7,34<br>207,24   | -11.553,00    | 79.824,00      |
| Artigo 8º I, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p.  | -4,56<br>0,23      | -16,46<br>1,73   | -0,13<br>0,35  | 30,47<br>0,91    | -8,20<br>1,48    | -732.302,05   | -1.547.783,42  |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -4,02<br>0,78      | -17,54<br>0,66   | 1,42<br>1,89   | 29,38<br>-0,17   | -7,71<br>1,97    | -943.433,89   | -5.104.816,95  |
| Artigo 8º II, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | -4,48<br>0,32      | -17,90<br>0,29   | 0,43<br>0,91   | 30,30<br>0,75    | -7,93<br>1,75    | -93.619,45    | -435.203,58    |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | -0,45<br>4,35      | 1,41<br>19,61    | -0,37<br>0,11  | 0,25<br>-29,31   | 2,97<br>12,65    | -2.104,19     | 6.541,19       |
| Artigo 8º IV, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -0,51<br>4,29      | -10,29<br>7,91   | -1,54<br>-1,07 | -9,10<br>-38,66  | -11,51<br>-1,82  | -1.818,57     | -41.080,94     |
| Artigo 8º IV, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | 1,06<br>5,85       | -6,01<br>12,19   | 2,76<br>3,23   | 21,87<br>-7,68   | 12,59<br>22,28   | 53.468,50     | -344.251,09    |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | 0,00<br>0,00       | 5,29<br>232,37   | 0,00<br>0,00   | -1,41<br>-112,95 | 11,12<br>313,76  | 0,00          | 370.875,59     |
|                                              |                    |                  |                |                  |                  | -5.904.992,08 | -12.685.620,15 |

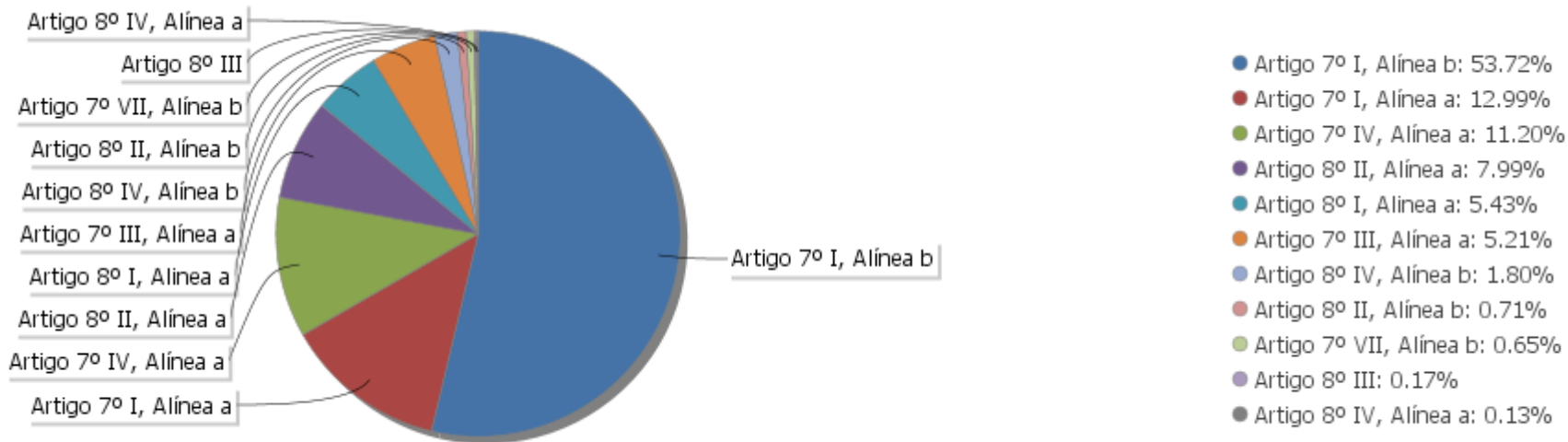
## Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 233.153.021,58 | 82,68 | 233.153.021,58        | 82,68     |
| de 31 a 364 dias  | 10.926.229,49  | 3,87  | 244.079.251,07        | 86,55     |
| acima de 365 dias | 37.931.795,87  | 13,45 | 282.011.046,94        | 100,00    |

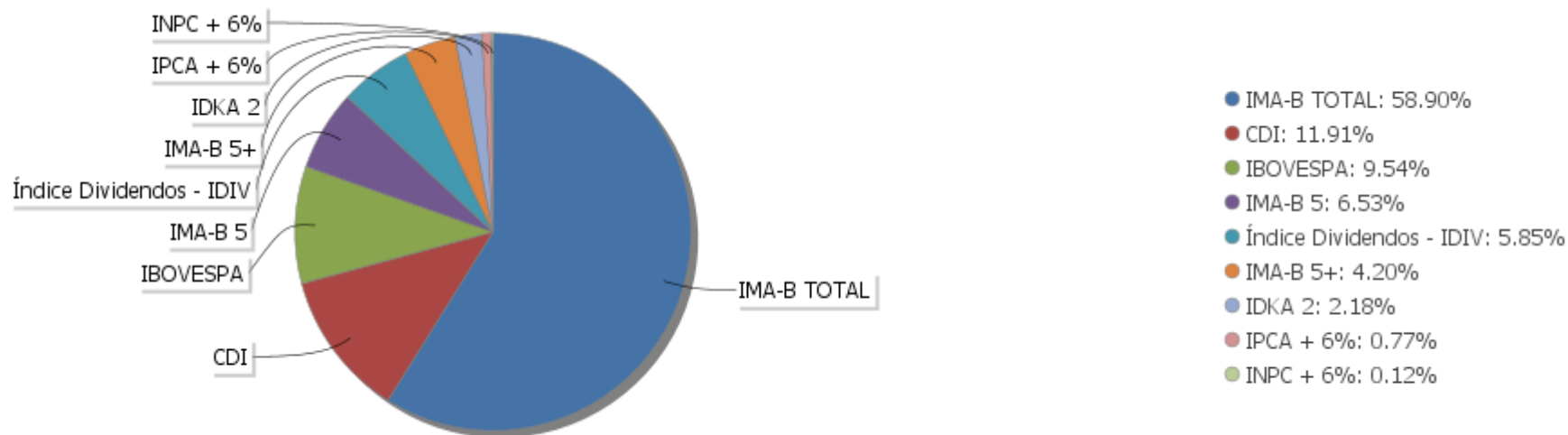


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

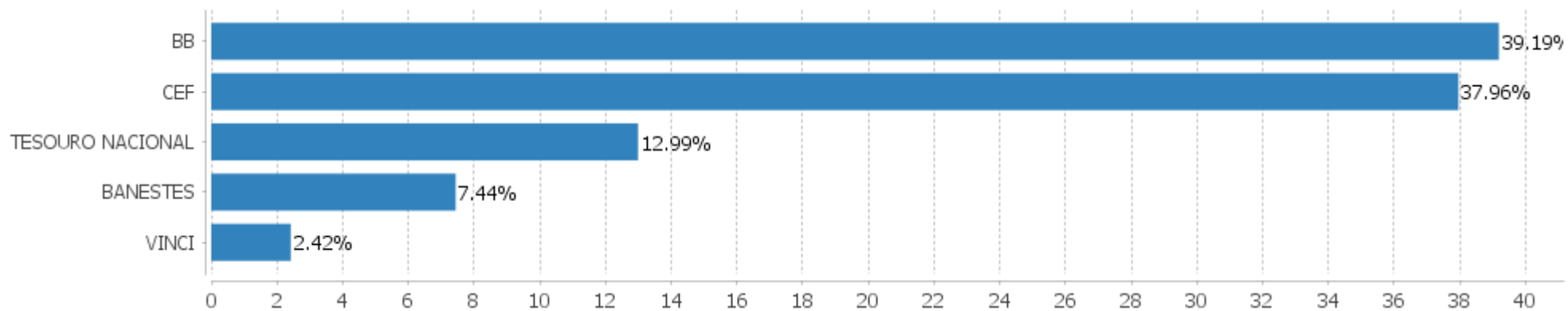


Alocação Por Estratégia



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 |      |       |      | -4,38     |
| IPCA + 5,86%   | 0,71  | 0,66  | 0,57   | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,88 | 0,72  | 1,12  |      |       |      | 5,74      |
| p.p. indexador | -0,85 | -1,86 | -11,35 | 2,48 | 1,98 | 2,24 | 4,21 | -2,85 | -3,17 |      |       |      | -10,13    |
| 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      |

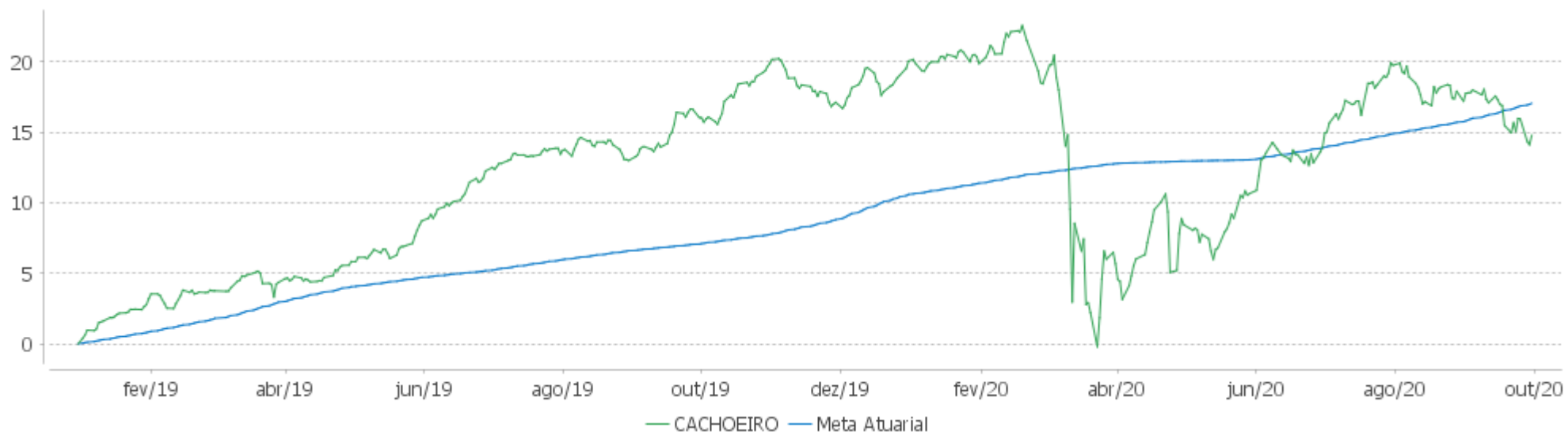
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

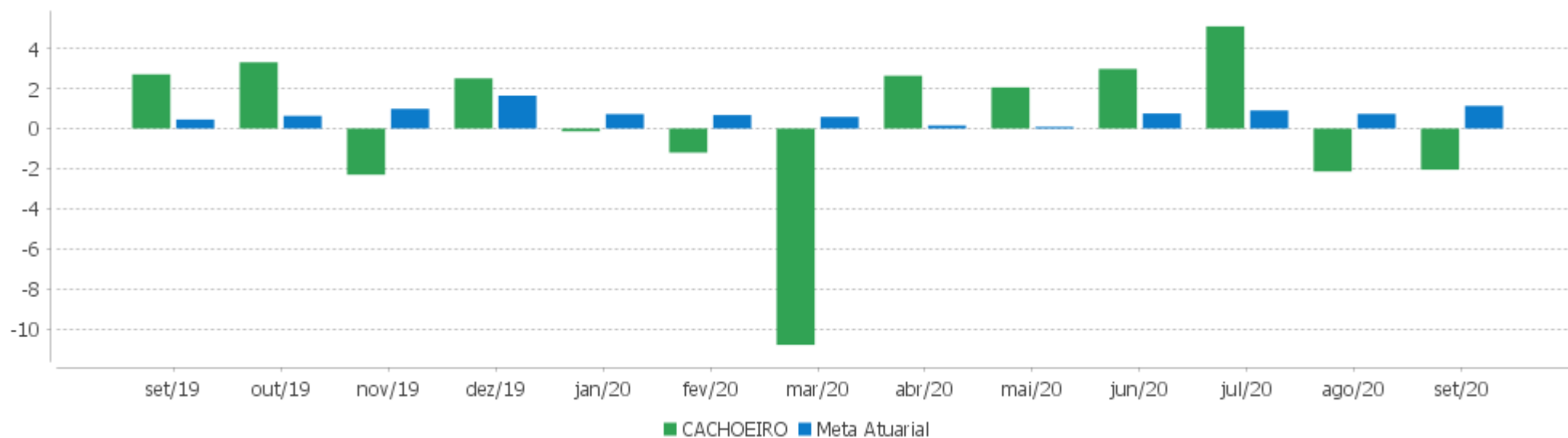
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 12         | 57,14     | 03 meses         | 0,74     | 2,74          | -2,00      | 8,46               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 9          | 42,86     | 06 meses         | 8,64     | 3,72          | 4,92       | 11,14              |
|                                 |            |           | 12 meses         | -1,08    | 9,22          | -10,30     | 15,03              |
|                                 |            |           | 24 meses         |          |               |            |                    |
|                                 |            |           | 36 meses         |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,09       | 2020-07   |                  |          |               |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -10,78     | 2020-03   | Desde 31/12/2018 | 14,79    | 16,94         | -2,15      | 11,62              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                            | No Mês         | No Ano          | 3 meses        | 6 meses       | 12 meses        | 24 meses        | 36 meses        |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF<br>Var. IPCA + 6% p.p.                         | -0,63<br>-1,76 | 4,58<br>-1,27   | 1,00<br>-1,78  | 6,07<br>2,28  | 7,34<br>-1,98   | 25,93<br>6,72   | 33,28<br>1,29   |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.      | -1,53<br>-0,02 | -1,00<br>-0,28  | 0,89<br>-0,07  | 5,84<br>-0,12 | 1,68<br>-0,43   | 33,36<br>-0,78  | 36,41<br>-1,16  |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.               | -5,05<br>-3,54 | -9,84<br>-9,12  | -1,55<br>-2,51 | 3,14<br>-2,83 | -7,24<br>-9,35  | 33,89<br>-0,25  | 32,47<br>-5,09  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.        | -0,16<br>-0,04 | 4,29<br>-0,22   | 1,21<br>-0,09  | 4,96<br>-0,15 | 6,91<br>-0,33   | 23,18<br>-0,58  | 30,91<br>-0,93  |
| BB PREV RF VII<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                                    | 0,19<br>1,70   | 2,64<br>3,36    | 0,98<br>0,02   | 3,41<br>-2,56 | 5,12<br>3,01    | 17,74<br>-16,40 | 26,32<br>-11,25 |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.                                       | 0,11<br>0,10   | 4,55<br>-0,86   | 1,61<br>-0,38  | 5,24<br>-0,17 | 7,28<br>-0,72   | 20,27<br>-1,61  | 29,41<br>-2,85  |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p.    | 0,04<br>0,02   | 4,84<br>-0,57   | 1,66<br>-0,33  | 5,27<br>-0,15 | 7,35<br>-0,65   | 20,53<br>-1,35  | 29,77<br>-2,49  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.                          | -0,15<br>-0,03 | 4,30<br>-0,20   | 1,18<br>-0,11  | 4,93<br>-0,17 | 6,95<br>-0,29   | 23,16<br>-0,59  | 30,94<br>-0,89  |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.              | -1,56<br>-0,04 | -0,93<br>-0,21  | 0,83<br>-0,13  | 5,77<br>-0,20 | 1,83<br>-0,28   | 33,39<br>-0,75  | 36,49<br>-1,07  |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI<br>Var. INPC + 6% p.p.             | -0,10<br>-1,47 | 3,58<br>-2,99   | 1,05<br>-2,17  | 4,36<br>-0,13 | 6,19<br>-3,93   | 22,78<br>2,67   | 41,08<br>8,79   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.      | -2,64<br>-0,04 | -4,82<br>-0,27  | 0,65<br>-0,10  | 6,56<br>-0,22 | -2,10<br>-0,43  | 40,97<br>-1,45  | 39,57<br>-1,69  |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B 5+ p.p.               | -2,65<br>-0,05 | -4,82<br>-0,26  | 0,59<br>-0,16  | 6,44<br>-0,34 | -1,87<br>-0,19  | 41,55<br>-0,87  | 40,12<br>-1,14  |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | -1,54<br>-0,03 | -0,98<br>-0,26  | 0,89<br>-0,07  | 5,76<br>-0,20 | 1,73<br>-0,38   | 33,13<br>-1,01  | 36,52<br>-1,04  |
| NTN-B 150555<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                                      | -3,22<br>-1,71 | -9,33<br>-8,61  | 0,44<br>-0,52  | 6,86<br>0,90  | -7,92<br>-10,03 | 39,49<br>5,35   | 27,10<br>-10,46 |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI<br>% do CDI                        | 0,15<br>97,35  | -0,40<br>-17,44 | 1,16<br>227,25 | 0,24<br>18,84 | 0,64<br>18,02   | 7,39<br>73,64   | 15,09<br>86,94  |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                             | 0,02<br>15,30  | 1,82<br>79,94   | 0,44<br>86,28  | 1,22<br>97,65 | 2,98<br>84,04   | 9,27<br>92,40   | 16,58<br>95,53  |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                              | -0,00          | 1,77            | 0,39           | 0,97          | 2,90            | 9,20            | 16,28           |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                                              | No Mês             | No Ano            | 3 meses        | 6 meses           | 12 meses         | 24 meses         | 36 meses             |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|-------------------|----------------|-------------------|------------------|------------------|----------------------|
| % do CDI                                                                                     | -1,68              | 77,58             | 76,38          | 77,46             | 81,81            | 91,67            | 93,76                |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -2,96<br>1,67      | -4,05<br>17,03    | 4,70<br>8,01   | 48,11<br>33,33    | 5,50<br>15,30    | 60,57<br>22,72   | 61,54<br>31,05       |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO<br>Var. IBOVESPA p.p.                                             | -5,93<br>-1,13     | -20,37<br>-2,18   | 1,37<br>1,85   | 33,48<br>3,92     | -4,18<br>5,51    | 45,25<br>26,01   | 33,42<br>6,08        |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.                     | -1,49<br>3,13      | -19,77<br>1,30    | 2,10<br>5,40   | 26,32<br>11,54    | -5,30<br>4,51    | 28,77<br>-9,08   | 20,04<br>-10,45      |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.         | -4,93<br>-0,30     | -17,58<br>3,49    | -0,96<br>2,35  | 19,42<br>4,64     | -6,98<br>2,83    | 43,54<br>5,70    | 33,91<br>3,42        |
| CXCE11B<br>Var. IBOVESPA p.p.                                                                | 0,27<br>5,06       | -9,68<br>8,52     | 0,37<br>0,84   | 18,03<br>-11,53   | 8,20<br>17,88    | 227,21<br>207,97 | 1.149,01<br>1.121,67 |
| BB ACOES ALO ETF<br>% do CDI                                                                 | -4,48<br>-2.854,16 | -17,90<br>-786,69 | 0,43<br>84,82  | 30,30<br>2.423,01 | -7,93<br>-223,87 | 21,80<br>217,20  | 30,19<br>173,95      |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | -0,45<br>4,35      | 1,41<br>19,61     | -0,37<br>0,11  | 0,25<br>-29,31    | 2,97<br>12,65    | 15,39<br>-3,84   |                      |
| FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA<br>Var. IPCA + 6% p.p.                                    | -0,51<br>-1,63     | -10,29<br>-16,13  | -1,54<br>-4,32 | -9,10<br>-12,89   | -11,51<br>-20,83 | -70,92<br>-90,12 | -71,24<br>-103,22    |
| BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI<br>Var. IBOVESPA p.p.                                      | -4,50<br>0,29      | -15,72<br>2,47    | 0,03<br>0,51   | 31,28<br>1,72     | -7,57<br>2,11    | 19,79<br>0,55    | 26,66<br>-0,67       |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                          | -4,69<br>0,11      | -18,09<br>0,11    | -0,46<br>0,02  | 28,86<br>-0,70    | -9,73<br>-0,05   | 18,23<br>-1,00   | 25,46<br>-1,88       |
| CDI                                                                                          | 0,16               | 2,28              | 0,51           | 1,25              | 3,54             | 10,04            | 17,36                |
| IBOVESPA                                                                                     | -4,80              | -18,20            | -0,48          | 29,56             | -9,68            | 19,23            | 27,34                |
| INPC + 6%                                                                                    | 1,36               | 6,58              | 3,22           | 4,50              | 10,12            | 20,11            | 32,29                |
| IPCA + 6%                                                                                    | 1,13               | 5,85              | 2,78           | 3,79              | 9,32             | 19,21            | 31,99                |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

| Indexador                     | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| <b>Renda Fixa</b>             |        |        |         |         |          |          |          |
| IRF-M 1                       | 0,15   | 3,12   | 0,51    | 1,66    | 4,54     | 12,32    | 19,91    |
| IRF-M 1+                      | -0,91  | 5,40   | -0,59   | 3,90    | 7,61     | 30,00    | 36,94    |
| IRF-M TOTAL                   | -0,56  | 4,62   | -0,24   | 3,15    | 6,56     | 24,50    | 31,64    |
| IMA-B 5                       | -0,12  | 4,51   | 1,30    | 5,11    | 7,24     | 23,75    | 31,84    |
| IMA-B 5+                      | -2,60  | -4,56  | 0,75    | 6,78    | -1,67    | 42,42    | 41,26    |
| IMA-B TOTAL                   | -1,51  | -0,72  | 0,96    | 5,97    | 2,11     | 34,14    | 37,56    |
| IMA-C TOTAL                   | 2,95   | 17,78  | 9,60    | 18,32   | 19,95    | 48,39    | 67,40    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | -0,71  | 1,96   | 0,25    | 2,99    | 3,90     | 21,11    | 27,38    |
| IMA-GERAL TOTAL               | -0,60  | 2,41   | 0,53    | 3,43    | 4,35     | 21,85    | 28,42    |
| IDKA 2                        | 0,02   | 5,41   | 1,99    | 5,41    | 8,00     | 21,88    | 32,26    |
| IDKA 20                       | -4,30  | -11,82 | 0,58    | 7,11    | -8,89    | 56,79    | 46,43    |
| CDI                           | 0,16   | 2,28   | 0,51    | 1,25    | 3,54     | 10,04    | 17,36    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | -4,80  | -18,20 | -0,48   | 29,56   | -9,68    | 19,23    | 27,34    |
| IBRX 100                      | -4,58  | -17,42 | -0,04   | 30,33   | -8,59    | 23,26    | 30,47    |
| IBRX 50                       | -4,62  | -18,06 | -0,37   | 31,30   | -10,02   | 16,09    | 24,57    |
| SMALL CAP                     | -5,44  | -18,93 | 2,27    | 35,50   | -1,78    | 54,49    | 42,68    |
| IFIX                          | 0,46   | -12,59 | -0,41   | 12,06   | 4,12     | 30,92    | 25,84    |
| Índice Consumo - ICON         | -3,96  | -9,26  | 1,83    | 42,00   | -1,04    | 53,03    | 27,90    |
| Índice Dividendos - IDIV      | -4,63  | -21,08 | -3,31   | 14,78   | -9,81    | 37,85    | 30,49    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,64   | 1,34   | 1,24    | 0,81    | 3,14     | 6,12     | 10,92    |
| INPC                          | 0,87   | 2,04   | 1,68    | 1,49    | 3,89     | 6,93     | 11,17    |
| IGPM                          | 4,34   | 14,40  | 9,59    | 12,51   | 17,94    | 21,91    | 34,14    |
| SELIC                         | 0,16   | 2,28   | 0,51    | 1,25    | 3,54     | 10,04    | 17,37    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

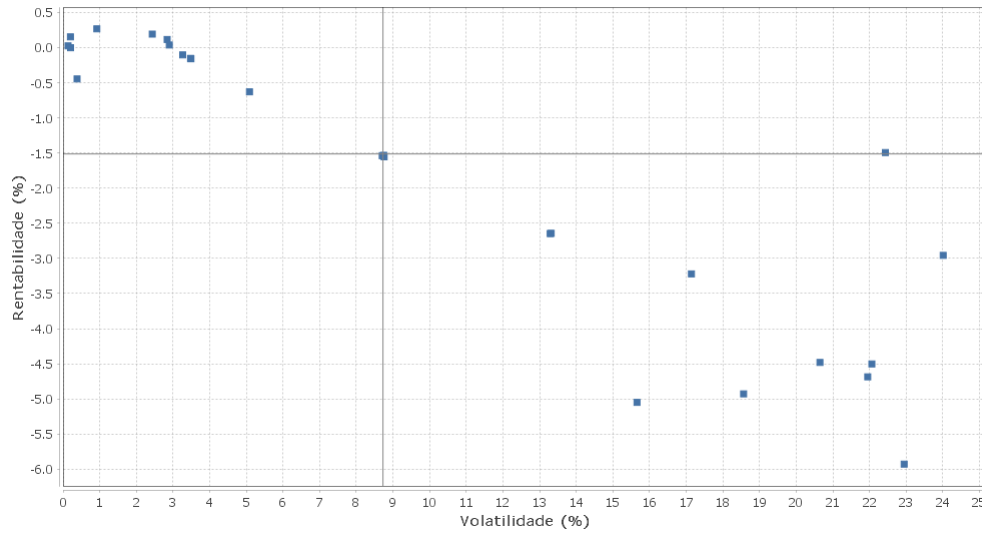
| APR | Data       | Ativo                                         | Aplicação  | Resgate    | Quantidade       | Valor Cota   |
|-----|------------|-----------------------------------------------|------------|------------|------------------|--------------|
| 141 | 08/09/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 0,00       | 50.000,00  | 21.841,23795600  | 2,2892475280 |
| 142 | 23/09/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 526.000,00 | 0,00       | 229.732,65569200 | 2,2896178970 |
| 143 | 23/09/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 22.114,28  | 0,00       | 9.658,50242000   | 2,2896178970 |
| 144 | 23/09/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 142.000,00 | 0,00       | 38.203,13954400  | 3,7169720000 |
| 145 | 28/09/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 0,00       | 330.000,00 | 144.146,76411300 | 2,2893333890 |
| 146 | 28/09/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI            | 0,00       | 60.000,00  | 26.208,50256600  | 2,2893333890 |



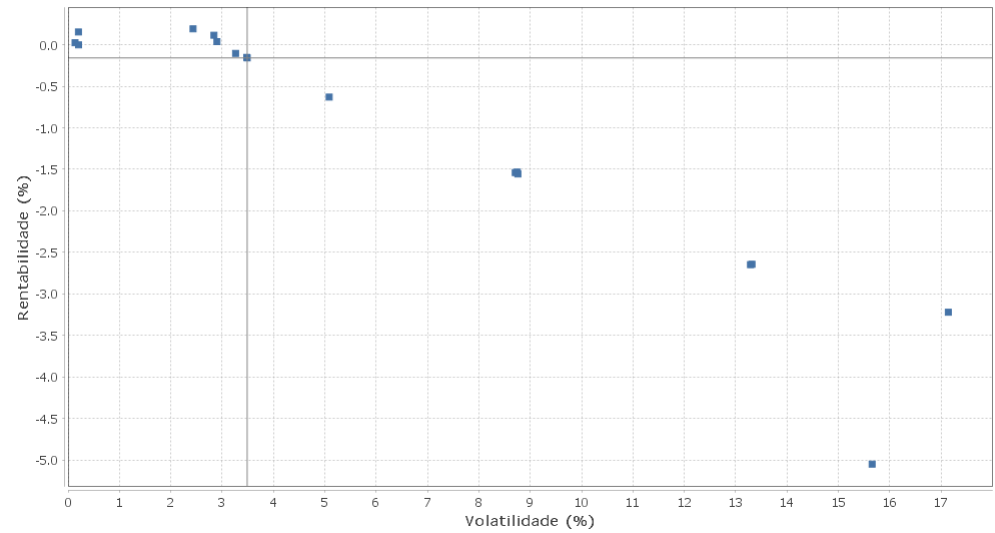
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

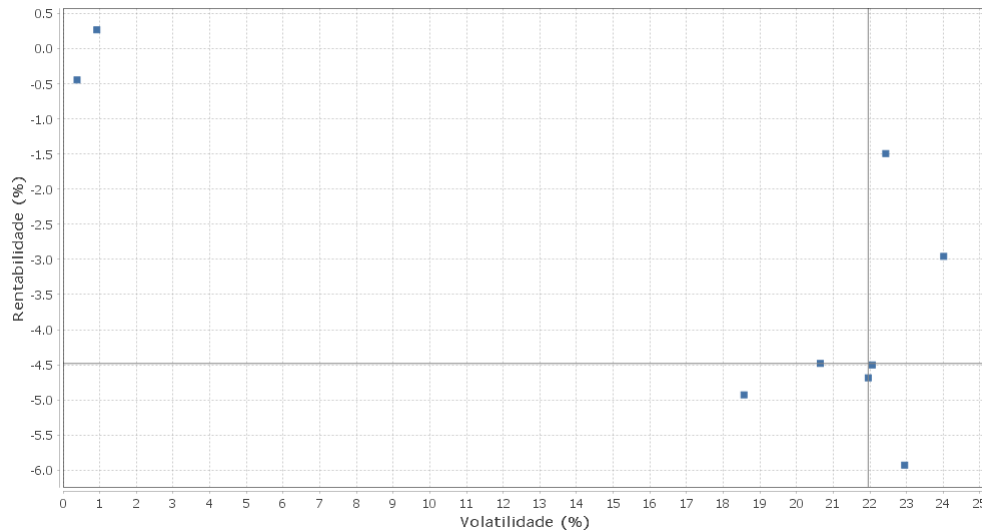
CACHOEIRO - No Mês



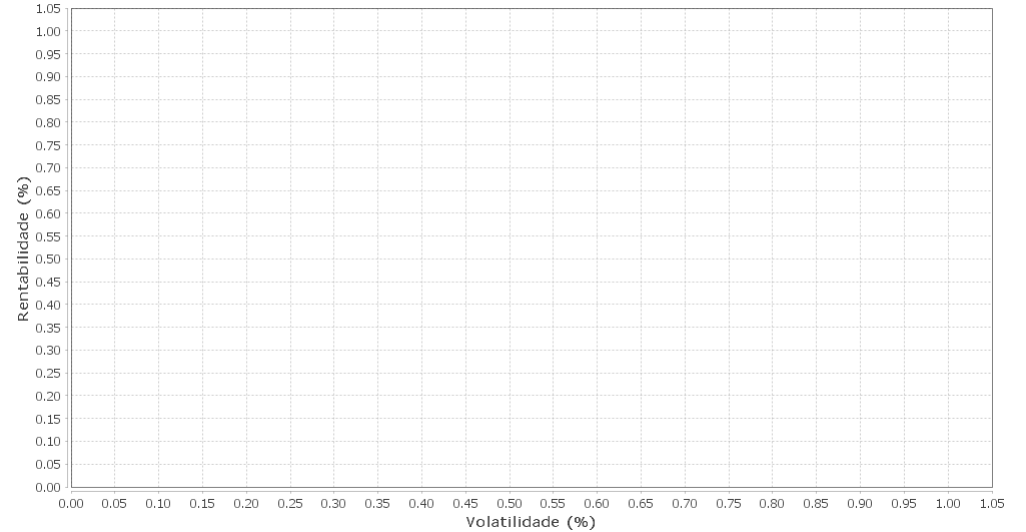
Renda Fixa - No Mês



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 |
|--------------------------------------------------------|-------------------------|--------------|-------|-------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI                     | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,14         | 0,06  | 0,00  | -0,97  | 0,02  | 21.009.830,03 | 7,45       |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI                | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,20         | 0,13  | -0,00 | -0,02  | 0,15  | 825.289,15    | 0,29       |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP          | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,21         | 0,08  | 0,00  | -0,78  | -0,00 | 9.761.053,08  | 3,46       |
| FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT               | Artigo 8º III           | 0,38         | 0,16  | 0,00  | -1,57  | -0,45 | 468.874,79    | 0,17       |
| CXCE11B                                                | Artigo 8º IV, Alínea b  | 0,92         | 0,32  | 0,00  | 0,12   | 0,27  | 5.081.000,00  | 1,80       |
| BB PREV RF VII                                         | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,43         | 0,55  | 0,00  | 0,01   | 0,19  | 962.087,03    | 0,34       |
| BB PREV RF IDKA2                                       | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,84         | 0,94  | 0,01  | -0,02  | 0,11  | 3.534.127,14  | 1,25       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP    | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,90         | 1,03  | 0,01  | -0,04  | 0,04  | 2.619.320,94  | 0,93       |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI                | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,26         | 0,92  | 0,00  | -0,08  | -0,10 | 343.965,34    | 0,12       |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                           | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,48         | 1,03  | 0,03  | -0,09  | -0,15 | 11.157.484,53 | 3,96       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP         | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,49         | 1,02  | 0,02  | -0,09  | -0,16 | 7.259.191,24  | 2,57       |
| FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF                            | Artigo 7º VII, Alínea b | 5,08         | 1,75  | 0,01  | -0,15  | -0,63 | 1.822.500,00  | 0,65       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP      | Artigo 7º III, Alínea a | 8,71         | 3,22  | 0,16  | -0,19  | -1,54 | 14.703.318,46 | 5,21       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP           | Artigo 7º I, Alínea b   | 8,75         | 3,24  | 0,52  | -0,19  | -1,53 | 47.678.899,96 | 16,91      |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 8,76         | 3,22  | 0,54  | -0,20  | -1,56 | 50.035.670,18 | 17,74      |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI                 | Artigo 7º I, Alínea b   | 13,29        | 5,16  | 0,10  | -0,21  | -2,65 | 5.675.903,35  | 2,01       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | Artigo 7º I, Alínea b   | 13,32        | 5,13  | 0,11  | -0,21  | -2,64 | 6.181.005,84  | 2,19       |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 15,66        | 5,47  | -0,00 | -0,33  | -5,05 | 16.058.447,39 | 5,69       |
| NTN-B 150555                                           | Artigo 7º I, Alínea a   | 17,14        | 7,25  | 0,87  | -0,20  | -3,22 | 36.625.743,50 | 12,99      |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS         | Artigo 8º II, Alínea a  | 18,57        | 10,57 | 0,21  | -0,27  | -4,93 | 6.819.071,87  | 2,42       |
| BB ACOES ALO ETF                                       | Artigo 8º II, Alínea b  | 20,65        | 10,39 | 0,06  | -0,22  | -4,48 | 1.996.007,73  | 0,71       |
| FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA                          | Artigo 8º I, Alínea a   | 21,95        | 11,05 | 0,16  | -0,22  | -4,69 | 5.087.816,02  | 1,80       |
| BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI                      | Artigo 8º I, Alínea a   | 22,06        | 10,77 | 0,32  | -0,21  | -4,50 | 10.229.110,59 | 3,63       |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI                     | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,43        | 11,86 | 0,19  | -0,07  | -1,49 | 5.571.749,05  | 1,98       |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                             | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,95        | 15,77 | 0,28  | -0,27  | -5,93 | 6.038.152,62  | 2,14       |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | Artigo 8º II, Alínea a  | 24,01        | 11,94 | 0,14  | -0,13  | -2,96 | 4.107.157,62  | 1,46       |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

No respectivo mês de setembro de 2020, observar que;

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III (0,17% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.