



**LDB**  
EMPRESAS

**CACHOEIRO**  
NOVEMBRO 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 14.12.2020.

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 82,82%

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	26,00	3,10	-6,09	37.091.820,66	12,50
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>26,00</b>	<b>3,10</b>	<b>-6,09</b>	<b>37.091.820,66</b>	<b>12,50</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	23,45	1,78	-7,39	16.494.507,93	5,56	279.018.560,81	5,91
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	51.132.878,53	17,24	5.721.224.105,90	0,89
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	1,17	48.721.091,70	16,42	5.938.047.265,27	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	7.366.004,52	2,48	19.732.912.783,40	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,21	1,34	6,29	3.593.254,38	1,21	7.802.150.183,83	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,73	2,49	-2,25	5.829.382,41	1,97	1.790.167.818,44	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,84	2,57	-2,17	6.353.381,37	2,14	1.749.025.544,15	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	6,28	2.655.272,26	0,90	10.336.804.140,67	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,01	1,31	5,87	11.325.030,92	3,82	4.474.614.326,56	0,25
BB	BB	BB PREV RF VII	2,42	1,17	4,35	978.125,25	0,33	242.932.832,47	0,40
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,29	5,22	349.395,75	0,12	579.143.570,98	0,06
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>10,44</b>	<b>1,89</b>	<b>1,00</b>	<b>154.798.325,02</b>	<b>52,18</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	12,76	1,95	1,14	15.018.917,77	5,06	2.917.609.578,10	0,51
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>12,76</b>	<b>1,95</b>	<b>1,14</b>	<b>15.018.917,77</b>	<b>5,06</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	0,36	0,15	2,05	10.803.692,13	3,64	4.499.544.566,86	0,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	2,14	24.451.033,88	8,24	2.405.684.296,02	1,02
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,25	1,84	1.657.201,55	0,56	1.973.690.561,66	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,27</b>	<b>0,16</b>	<b>2,19</b>	<b>36.911.927,56</b>	<b>12,44</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	8,23	1,21	5,71	1.842.114,00	0,62	193.821.613,42	0,95
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>8,23</b>	<b>1,21</b>	<b>5,71</b>	<b>1.842.114,00</b>	<b>0,62</b>		

<b>Renda Fixa</b>			<b>12,46</b>	<b>1,81</b>	<b>-0,52</b>	<b>245.663.105,01</b>	<b>82,82</b>		
-------------------	--	--	--------------	-------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,18%

## 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	44,26	14,66	-4,11	11.639.316,48	3,92	171.318.175,67	6,79
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	43,98	15,71	-5,97	5.840.323,24	1,97	121.324.330,95	4,81
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>43,99</b>	<b>15,01</b>	<b>-4,67</b>	<b>17.479.639,72</b>	<b>5,89</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	38,97	14,53	-13,70	6.472.223,42	2,18	126.983.157,44	5,10
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,86	14,26	-5,78	7.795.552,17	2,63	912.327.763,54	0,85
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,69	15,73	-15,23	6.819.879,16	2,30	1.328.168.471,54	0,51
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,85	8,65	2,46	4.385.650,96	1,48	176.046.448,61	2,49
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>41,92</b>	<b>13,70</b>	<b>-6,79</b>	<b>25.473.305,71</b>	<b>8,59</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	41,78	15,16	-6,09	2.283.096,24	0,77	189.041.101,99	1,21
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea b</b>			<b>41,78</b>	<b>15,16</b>	<b>-6,09</b>	<b>2.283.096,24</b>	<b>0,77</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	10,19	-5,36	-11,15	354.831,26	0,12	20.172.858,73	1,76
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>10,19</b>	<b>-5,36</b>	<b>-11,15</b>	<b>354.831,26</b>	<b>0,12</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CXCE11B	40,04	-0,20	69,39	5.381.500,00	1,81	147.512.832,39	3,65
		<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>	<b>40,04</b>	<b>-0,20</b>	<b>0,45</b>	<b>5.381.500,00</b>	<b>1,81</b>		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	38,89	12,39	-4,93	50.972.372,93	17,18		
		<b>Total</b>	<b>15,18</b>	<b>3,49</b>	<b>-0,77</b>	<b>296.635.477,94</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	37.091.820,66	12,50	10,00	30,00	70,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	154.798.325,02	52,18	20,00	30,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	15.018.917,77	5,06	0,00	5,00	30,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	36.911.927,56	12,44	1,00	4,00	30,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.842.114,00	0,62	0,00	1,00	2,00	15,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>245.663.105,01</b>	<b>82,82</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	17.479.639,72	5,89	1,00	10,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.473.305,71	8,59	2,00	15,00	20,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea b	Fundos de Índice de Ações	2.283.096,24	0,77	0,00	0,00	10,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	354.831,26	0,12	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.381.500,00	1,81	1,00	2,00	4,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>50.972.372,93</b>	<b>17,18</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 % do CDI	3,10 2.076,18	-6,09 -235,03	0,24 52,67	7,75 749,04	-2,63 -88,57	1.125.796,97	-2.617.973,63
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,89 1.265,64	1,00 38,76	0,36 78,38	4,80 463,70	2,86 96,30	2.874.415,97	1.401.202,60
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,95 1.302,56	1,14 44,08	0,57 123,80	5,14 496,96	3,16 106,13	286.864,06	169.477,10
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,16 107,16	2,19 84,62	0,32 69,79	1,02 98,33	2,56 85,98	57.444,75	386.364,94
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,21 807,63	5,71 220,39	0,44 94,69	3,37 325,96	7,26 244,00	21.975,00	99.438,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,01 -0,89	-4,67 1,17	8,91 -0,67	24,04 -0,55	1,58 0,97	2.281.248,39	614.929,69
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	13,70 -2,20	-6,79 -0,95	8,49 -1,09	24,26 -0,33	0,73 0,12	3.069.998,39	-2.167.642,40
Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	15,16 -0,74	-6,09 -0,25	9,26 -0,33	25,58 0,99	1,32 0,71	300.573,27	-148.115,07
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -15,90	1,17 7,01	-0,69 -10,27	-0,50 -25,09	1,50 0,89	0,00	5.394,61
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,36 -21,26	-11,15 -5,31	-1,46 -11,04	-2,97 -27,56	-11,67 -12,28	-20.081,76	-44.519,17
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,20 -16,11	0,45 6,29	8,00 -1,58	13,36 -11,22	9,51 8,90	-11.000,00	2.268,94
Artigo 9º A, III % do CDI	0,00 0,00	5,29 204,22	0,00 0,00	0,00 0,00	3,44 115,52	0,00	370.875,59
<b>CACHOEIRO (Total)</b>						<b>9.987.235,04</b>	<b>-1.928.298,80</b>

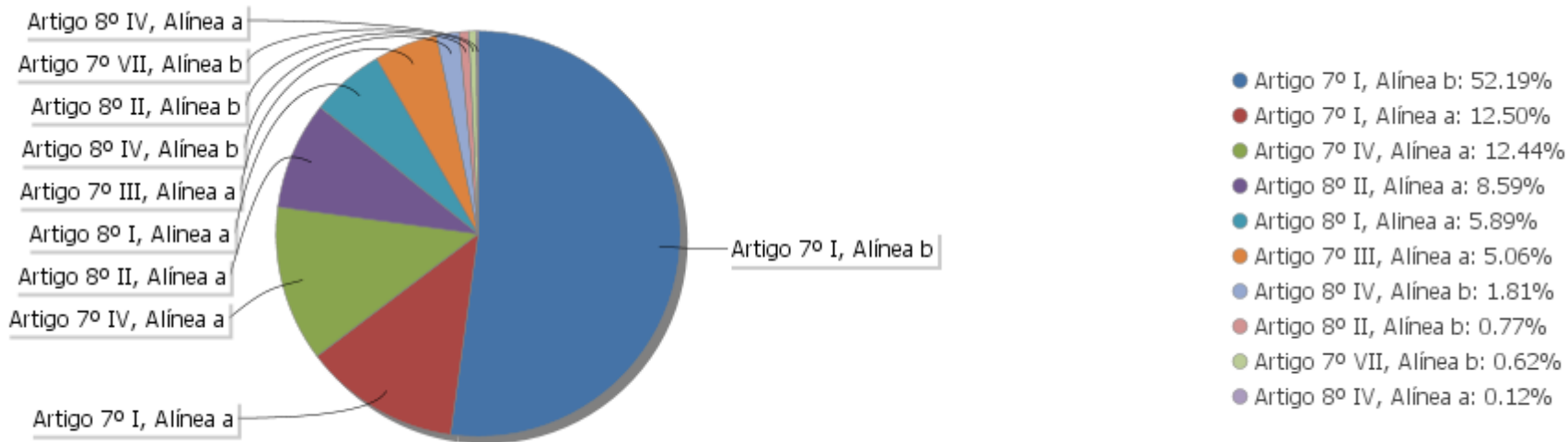
**Análise de Liquidez**

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	246.034.933,15	82,94	246.034.933,15	82,94
de 31 a 364 dias	12.181.203,13	4,11	258.216.136,28	87,05
acima de 365 dias	38.419.341,66	12,95	296.635.477,94	100,00

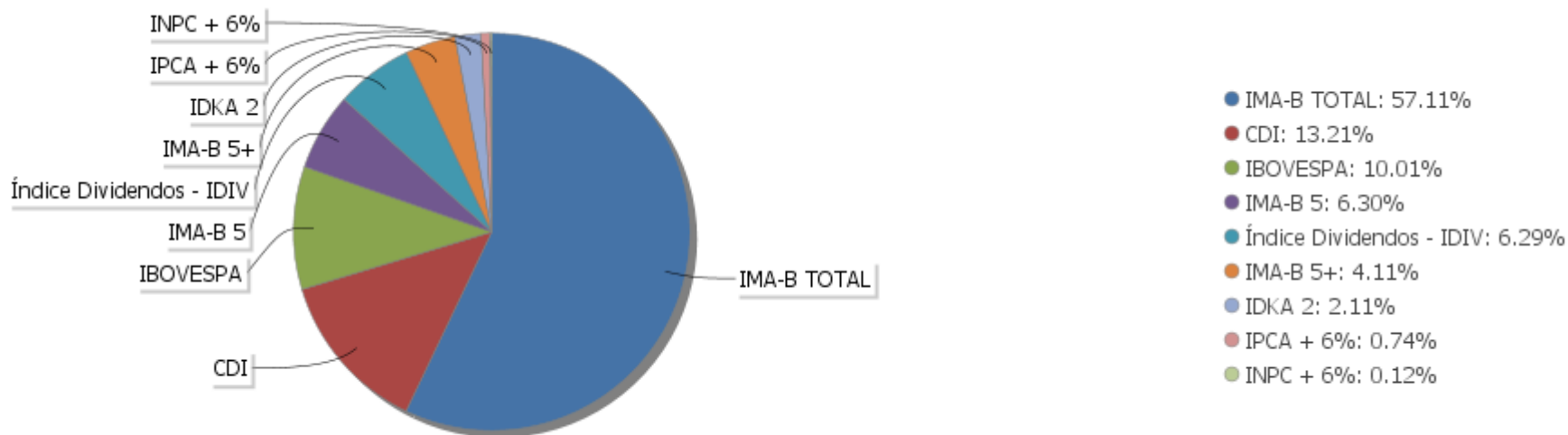


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

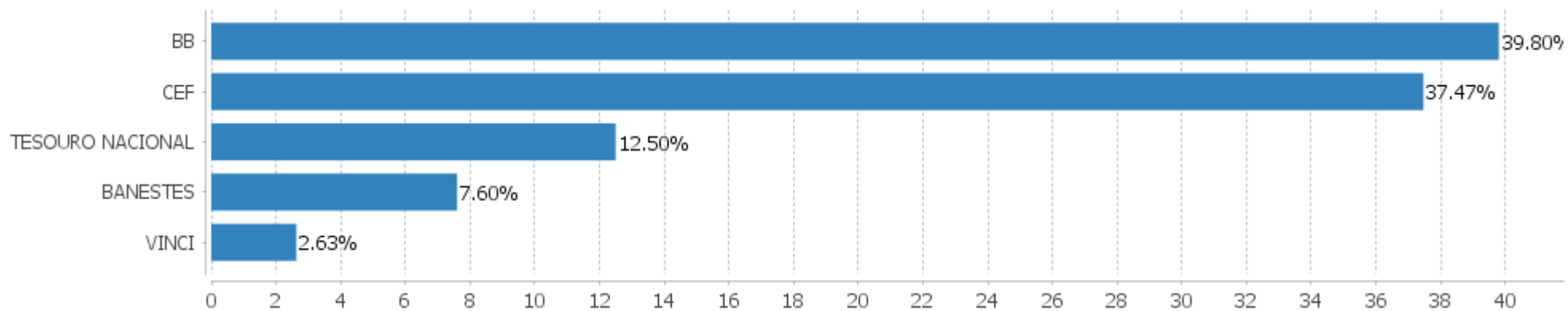


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

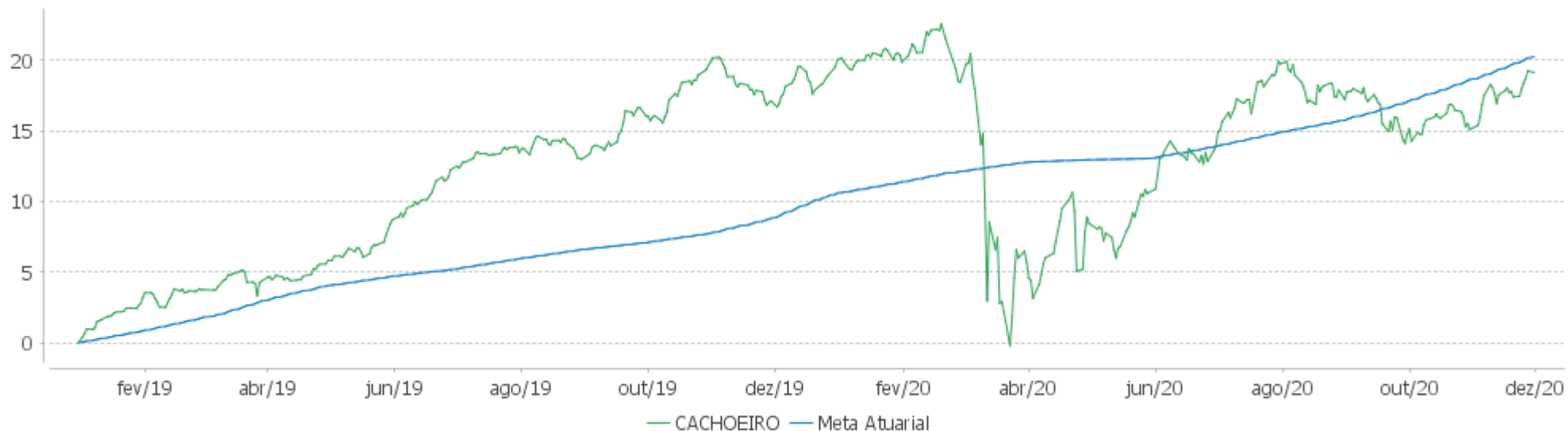
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	-0,14	-1,20	-10,78	2,63	2,05	2,97	5,09	-2,14	-2,05	0,27	3,49		-0,77
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35		8,60
p.p. indexador	-0,85	-1,86	-11,35	2,48	1,98	2,24	4,21	-2,85	-3,17	-1,07	2,15		-9,37
2019	3,19	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**

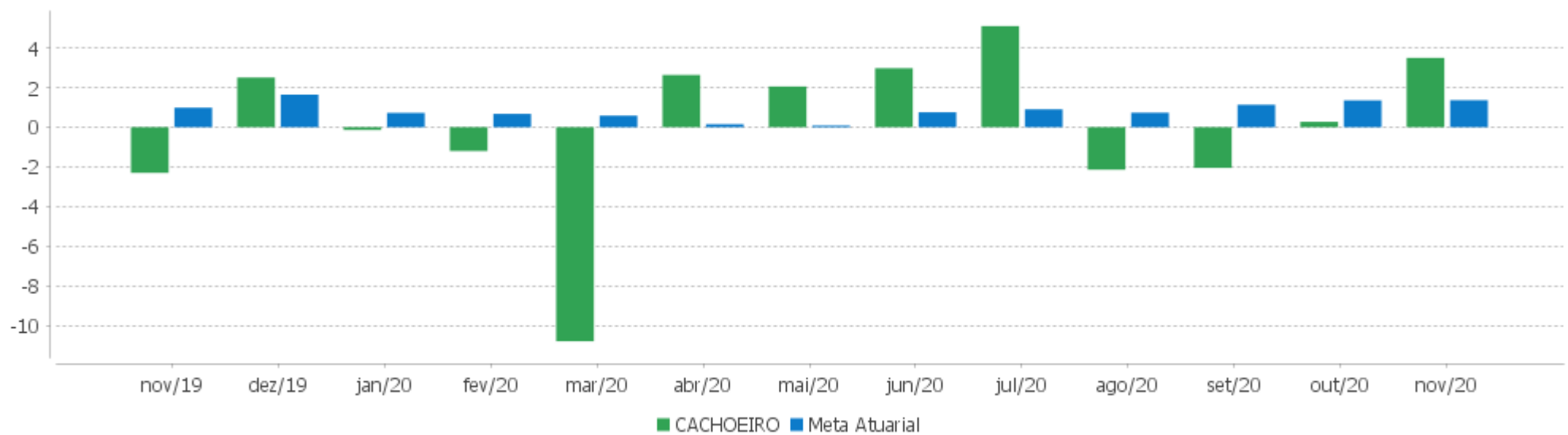
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	56,52	03 meses	1,65	3,85	-2,21	7,14
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	43,48	06 meses	7,65	6,30	1,35	7,63
			12 meses	1,71	10,39	-8,68	15,18
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,09	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,78	2020-03	Desde 31/12/2018	19,13	20,10	-0,98	11,25

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
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,78 -0,22	-7,39 -8,87	-2,47 -3,14	3,44 -1,87	-5,01 -8,52	23,91 -2,91	38,48 -3,75
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,17 -0,32	0,62 -0,05	5,19 -0,12	3,18 -0,34	26,04 -0,79	41,07 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	5,82 -0,28	1,31 -0,09	3,83 -0,16	7,10 -0,31	21,07 -0,62	32,11 -0,96
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,17 -0,83	4,35 2,87	1,86 1,19	3,69 -1,62	5,31 1,79	16,61 -10,22	27,51 -14,73
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,34 0,09	6,29 -0,47	1,79 0,48	4,57 0,23	7,52 -0,53	19,65 -1,24	30,22 -2,34
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,31 -0,01	5,87 -0,23	1,35 -0,05	3,81 -0,18	7,13 -0,28	21,12 -0,57	32,19 -0,88
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,03	6,28 -0,49	1,41 0,10	4,27 -0,06	7,44 -0,61	19,53 -1,35	30,28 -2,28
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,24 -0,24	0,60 -0,07	5,13 -0,18	3,24 -0,27	26,17 -0,66	41,14 -1,09
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,29 -0,13	5,22 -4,36	1,47 -2,75	3,76 -3,20	6,37 -5,09	20,22 -1,90	40,89 6,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,57 -0,02	-2,17 -0,29	0,07 -0,07	6,38 -0,14	0,33 -0,35	29,21 -1,12	47,03 -1,76
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,49 -0,09	-2,25 -0,37	-0,01 -0,15	6,20 -0,33	0,41 -0,27	29,47 -0,86	47,47 -1,33
NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,10 1,10	-6,09 -7,57	0,24 -0,43	7,75 2,44	-2,63 -6,15	27,61 0,79	40,32 -1,91
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,25 166,42	-0,12 -4,53	0,43 93,51	1,91 184,62	0,28 9,54	6,54 70,74	13,96 85,63
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 105,63	2,14 82,75	0,34 73,60	1,02 98,87	2,50 84,20	8,51 92,13	15,52 95,17
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,15 103,54	2,05 79,00	0,27 58,73	0,91 88,15	2,40 80,86	8,40 90,87	15,20 93,21
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	1,21 -0,15	5,71 -3,03	0,44 -3,45	3,37 -3,00	7,26 -3,26	24,58 3,59	33,20 -0,18
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	1,95	1,14	0,57	5,14	3,16	25,88	41,04

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.	-0,05	-0,34	-0,10	-0,17	-0,36	-0,95	-1,19
<b>BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI</b>	<b>14,66</b>	<b>-4,11</b>	<b>8,66</b>	<b>23,72</b>	<b>2,04</b>	<b>21,33</b>	<b>51,07</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	1,73	-0,92	-0,87	1,43	-0,33	-0,23
<b>FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA</b>	<b>15,71</b>	<b>-5,97</b>	<b>9,41</b>	<b>24,68</b>	<b>0,37</b>	<b>20,59</b>	<b>49,19</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,19	-0,13	-0,17	0,09	-0,24	-1,07	-2,11
<b>BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL</b>	<b>8,65</b>	<b>2,46</b>	<b>3,62</b>	<b>23,24</b>	<b>9,81</b>	<b>46,78</b>	<b>80,87</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-5,75	11,58	-6,19	1,94	9,86	14,01	20,35
<b>FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO</b>	<b>15,73</b>	<b>-10,06</b>	<b>6,25</b>	<b>29,26</b>	<b>1,22</b>	<b>41,06</b>	<b>56,65</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,17	-4,23	-3,33	4,67	0,61	19,39	5,35
<b>BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI</b>	<b>14,53</b>	<b>-6,81</b>	<b>14,43</b>	<b>27,36</b>	<b>3,15</b>	<b>43,39</b>	<b>48,84</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,13	2,32	4,61	6,06	3,20	10,62	-11,68
<b>FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>14,26</b>	<b>-5,78</b>	<b>8,69</b>	<b>18,42</b>	<b>2,25</b>	<b>38,18</b>	<b>59,11</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,14	3,34	-1,13	-2,89	2,30	5,41	-1,41
<b>CXCE11B</b>	<b>-0,20</b>	<b>69,39</b>	<b>8,00</b>	<b>33,94</b>	<b>84,18</b>	<b>463,11</b>	<b>3.451,27</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-16,11	75,23	-1,58	9,35	83,57	441,45	3.399,97
<b>FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA</b>	<b>-5,36</b>	<b>-11,15</b>	<b>-1,46</b>	<b>-2,97</b>	<b>-11,67</b>	<b>-71,11</b>	<b>-71,52</b>
Var. IPCA + 6% p.p.	-6,71	-19,88	-5,35	-9,34	-22,19	-92,09	-104,89
<b>BB ACOES ALO ETF</b>	<b>15,16</b>	<b>-6,09</b>	<b>9,26</b>	<b>25,58</b>	<b>1,32</b>	<b>23,79</b>	<b>54,51</b>
% do CDI	10.141,87	-235,30	1.994,74	2.473,14	44,52	257,52	334,29
<b>CACHOEIRO</b>	<b>3,49</b>	<b>-0,77</b>	<b>1,65</b>	<b>7,65</b>	<b>1,71</b>		
Var. IPCA + 6% p.p.	2,14	-9,50	-2,24	1,28	-8,81		
<b>CDI</b>	<b>0,15</b>	<b>2,59</b>	<b>0,46</b>	<b>1,03</b>	<b>2,97</b>	<b>9,24</b>	<b>16,31</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>15,90</b>	<b>-5,84</b>	<b>9,58</b>	<b>24,59</b>	<b>0,61</b>	<b>21,66</b>	<b>51,30</b>
<b>INPC + 6%</b>	<b>1,42</b>	<b>9,58</b>	<b>4,22</b>	<b>6,96</b>	<b>11,46</b>	<b>22,12</b>	<b>33,99</b>
<b>IPCA + 6%</b>	<b>1,36</b>	<b>8,73</b>	<b>3,89</b>	<b>6,37</b>	<b>10,52</b>	<b>20,99</b>	<b>33,37</b>

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
<b>Meta Atuarial</b>							



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

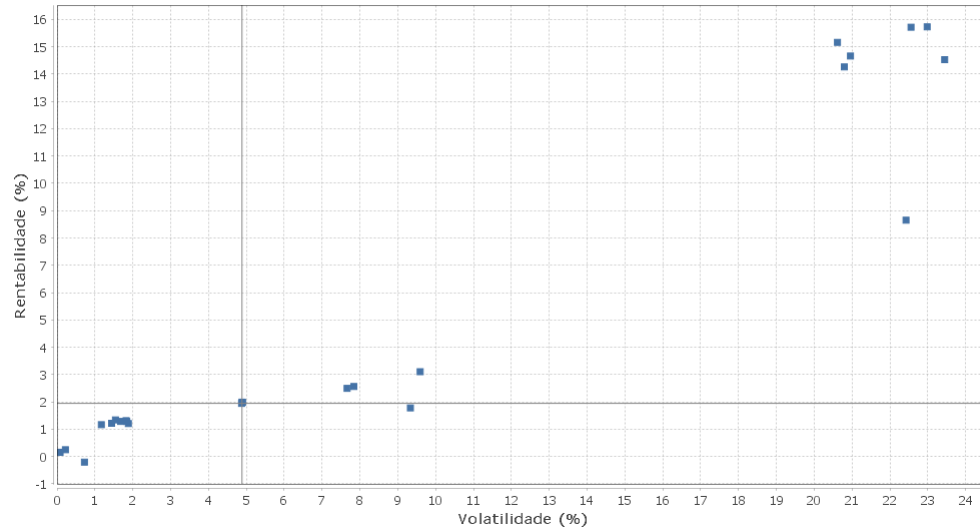
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
164	03/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.535,17797200	2,2924379240
169	03/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.810,84140900	2,2924379240
172	04/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.830.061,61	0,00	798.210,10802700	2,2927066340
166	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.000,00	0,00	13.953,36766700	2,2933531720
162	11/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	127.000,00	0,00	34.120,30335300	3,7221240000
163	17/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	46.000,00	0,00	12.354,79423700	3,7232510000
167	19/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	425.000,00	0,00	185.228,16877300	2,2944674280
168	23/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	123.000,00	0,00	53.600,77747100	2,2947428340
170	23/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.715,57357300	2,2947428340
174	24/11/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	828.802,34	0,00	482.295,54502013	1,7184532400
165	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	150.000,00	65.352,95828800	2,2952289220
171	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.141,18331500	2,2952289220
173	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.114,28	0,00	9.634,89078900	2,2952289220
<b>Total</b>						

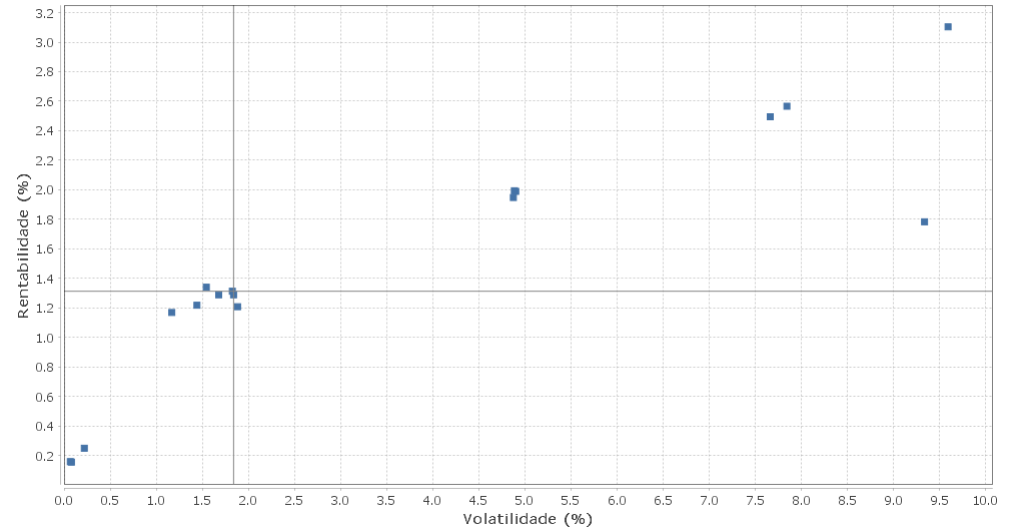
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

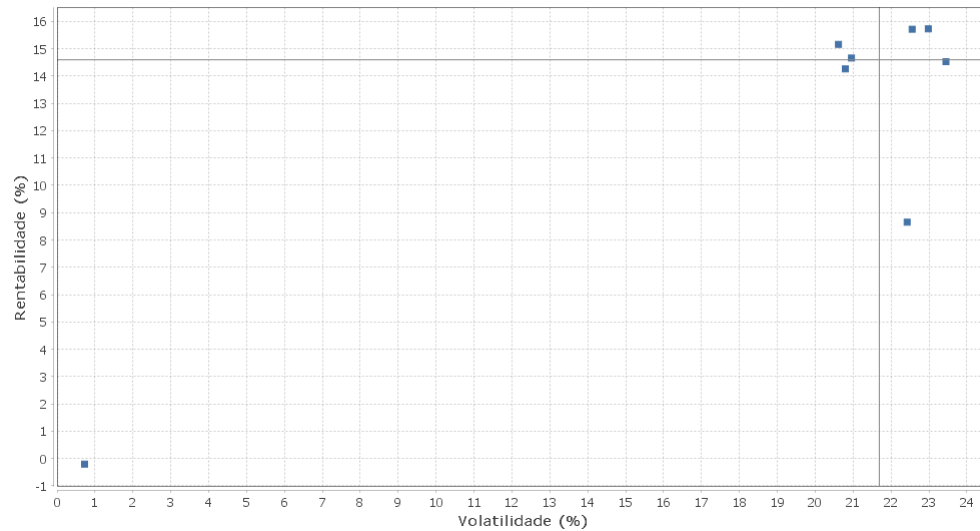
CACHOEIRO - No Mês



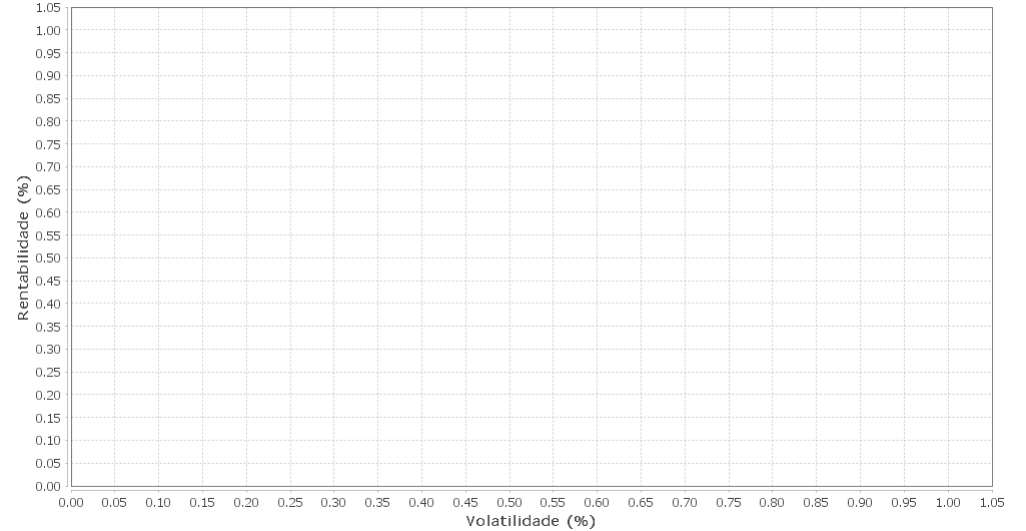
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 9.422.534,07

Value-At-Risk: 3,18%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,12	0,16	24.451.033,88	8,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,13	0,00	0,07	0,15	10.803.692,13	3,64
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,22	0,11	-0,00	0,45	0,25	1.657.201,55	0,56
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	0,72	2,41	0,00	-0,49	-0,20	5.381.500,00	1,81
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	0,90	0,00	0,87	1,17	978.125,25	0,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,01	0,74	1,22	2.655.272,26	0,90
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,91	0,01	0,77	1,34	3.593.254,38	1,21
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,08	0,00	0,68	1,29	349.395,75	0,12
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,83	0,99	0,03	0,64	1,31	11.325.030,92	3,82
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,02	0,62	1,29	7.366.004,52	2,48
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	1,88	1,75	0,01	0,56	1,21	1.842.114,00	0,62
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,87	2,66	0,12	0,37	1,95	15.018.917,77	5,06
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,42	0,38	1,99	51.132.878,53	17,24
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,40	0,38	1,99	48.721.091,70	16,42
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,66	4,12	0,07	0,31	2,49	5.829.382,41	1,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,84	4,17	0,08	0,31	2,57	6.353.381,37	2,14
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	9,33	4,66	0,02	0,17	1,78	16.494.507,93	5,56
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	9,59	6,16	0,68	0,31	3,10	37.091.820,66	12,50
BB ACOES ALO ETF	Artigo 8º II, Alínea b	20,61	9,61	0,06	0,73	15,16	2.283.096,24	0,77
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,79	9,69	0,21	0,68	14,26	7.795.552,17	2,63
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	20,96	10,18	0,33	0,69	14,66	11.639.316,48	3,92
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	22,42	10,18	0,12	0,38	8,65	4.385.650,96	1,48
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,56	11,31	0,18	0,69	15,71	5.840.323,24	1,97
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	10,78	0,20	0,68	15,73	6.819.879,16	2,30
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,45	10,61	0,19	0,61	14,53	6.472.223,42	2,18