



LDB
EMPRESAS

CACHOEIRO
DEZEMBRO 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 31.12.2020.

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 82,85%

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	25,92	9,23	2,58	40.515.038,84	12,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		25,92	9,23	2,58	40.515.038,84	12,75

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	23,39	7,94	-0,03	17.804.375,45	5,60	340.132.588,94	5,23
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	53.605.578,88	16,87	8.693.778.987,76	0,62
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	51.079.411,61	16,08	6.193.173.925,17	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	7.500.050,72	2,36	20.761.505.098,56	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,20	1,53	7,92	3.648.074,06	1,15	8.476.640.994,51	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,70	7,47	5,06	6.265.108,28	1,97	1.615.279.214,02	0,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,80	7,56	5,23	6.833.886,30	2,15	1.733.830.686,04	0,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	2.699.154,97	0,85	10.655.087.063,09	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,99	1,81	7,78	11.529.661,63	3,63	4.987.516.426,31	0,23
BB	BB	BB PREV RF VII	2,43	1,21	5,61	989.926,05	0,31	245.863.748,76	0,40
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,61	6,92	355.032,06	0,11	588.486.078,32	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,42	4,85	5,90	162.310.260,01	51,08		

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	12,72	4,85	6,05	15.747.899,49	4,96	2.989.829.287,39	0,53
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,72	4,85	6,05	15.747.899,49	4,96		

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	0,37	0,36	2,42	11.319.888,24	3,56	4.230.515.183,84	0,27
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,25	2,40	29.823.632,42	9,39	2.596.482.307,62	1,15
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,32	2,17	1.662.570,38	0,52	1.787.791.268,75	0,09
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,27	0,29	2,48	42.806.091,04	13,47		

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 CRÉDITO PRIVADO	8,17	1,78	7,59	1.874.882,00	0,59	199.070.839,42	0,94
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			8,17	1,78	7,59	1.874.882,00	0,59		

Renda Fixa			12,41	4,78	4,24	263.254.171,38	82,85		
-------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,15%

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	44,30	9,09	4,61	12.697.401,70	4,00	190.046.286,20	6,68
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	44,01	9,08	2,57	6.370.816,29	2,01	132.435.308,61	4,81
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,04	9,09	4,00	19.068.217,99	6,00		

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	38,95	6,64	-7,97	6.902.190,33	2,17	140.989.837,47	4,90
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,92	9,37	3,05	8.526.194,36	2,68	1.002.176.394,28	0,85
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,61	7,60	-8,78	7.338.158,79	2,31	1.388.354.610,95	0,53
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,87	5,18	7,76	4.612.714,77	1,45	191.546.487,48	2,41
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,92	7,48	0,18	27.379.258,25	8,62		

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	41,81	8,43	1,82	2.475.552,98	0,78	205.073.165,60	1,21
Sub-total Artigo 8º II, Alínea b			41,81	8,43	1,82	2.475.552,98	0,78		

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	11,16	-0,30	-7,06	353.751,02	0,11	19.918.441,04	1,78
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			11,16	-0,30	-7,06	353.751,02	0,11		

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	23,50	-2,35	-0,48	5.211.000,00	1,64	138.737.491,56	3,76
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	23,50	-2,35	-1,07	5.211.000,00	1,64		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	38,74	6,99	1,85	54.487.780,24	17,15		
		Total	15,16	5,16	4,37	317.741.951,62	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	40.515.038,84	12,75	10,00	30,00	70,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	162.310.260,01	51,08	20,00	30,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	15.747.899,49	4,96	0,00	5,00	30,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	42.806.091,04	13,47	1,00	4,00	30,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.874.882,00	0,59	0,00	1,00	2,00	15,00
	Total Renda Fixa	263.254.171,38	82,85				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	19.068.217,99	6,00	1,00	10,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	27.379.258,25	8,62	2,00	15,00	20,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea b	Fundos de Índice de Ações	2.475.552,98	0,78	0,00	0,00	10,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	353.751,02	0,11	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.211.000,00	1,64	1,00	2,00	4,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	54.487.780,24	17,15				40,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

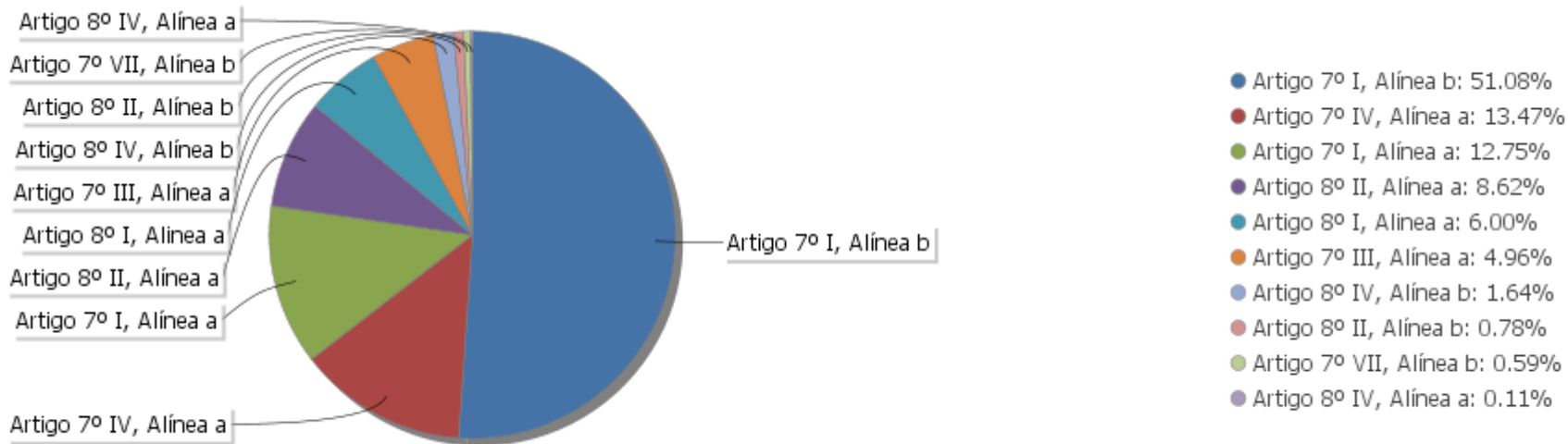
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	9,23 5.612,00	2,58 93,63	13,14 2.785,76	13,64 1.382,73	2,58 93,63	3.423.218,18	805.244,55
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	4,85 2.950,85	5,90 214,12	7,13 1.511,95	7,81 792,04	5,90 214,12	7.511.934,99	8.913.137,59
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	4,85 2.951,47	6,05 219,39	7,10 1.506,28	8,06 816,90	6,05 219,39	728.981,72	898.458,82
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,29 174,36	2,48 90,07	0,59 125,58	1,04 105,74	2,48 90,07	108.425,03	494.789,97
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,78 1.081,67	7,59 275,09	2,87 609,39	3,90 395,30	7,59 275,09	32.768,00	132.206,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,09 -0,21	4,00 1,08	24,49 -1,32	24,33 -0,88	4,00 1,08	1.588.578,27	2.203.507,96
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,48 -1,81	0,18 -2,73	21,49 -4,32	23,21 -2,00	0,18 -2,73	1.905.952,54	-261.689,86
Artigo 8º II, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	8,43 -0,87	1,82 -1,09	24,03 -1,78	24,56 -0,64	1,82 -1,09	192.456,74	44.341,67
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -9,30	1,17 -1,75	-0,24 -26,05	-0,61 -25,82	1,17 -1,75	0,00	5.394,61
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,30 -9,60	-7,06 -9,97	3,60 -22,20	2,00 -23,21	-7,06 -9,97	-1.080,24	-27.134,29
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,35 -11,64	-1,07 -3,99	5,25 -20,56	8,16 -17,05	-1,07 -3,99	-124.758,51	-76.697,65
Artigo 9º A, III % do CDI	0,00 0,00	5,29 191,73	0,00 0,00	0,00 0,00	5,29 191,73	0,00	370.875,59
CACHOEIRO (Total)						15.366.476,72	13.502.434,96

Análise de Liquidez

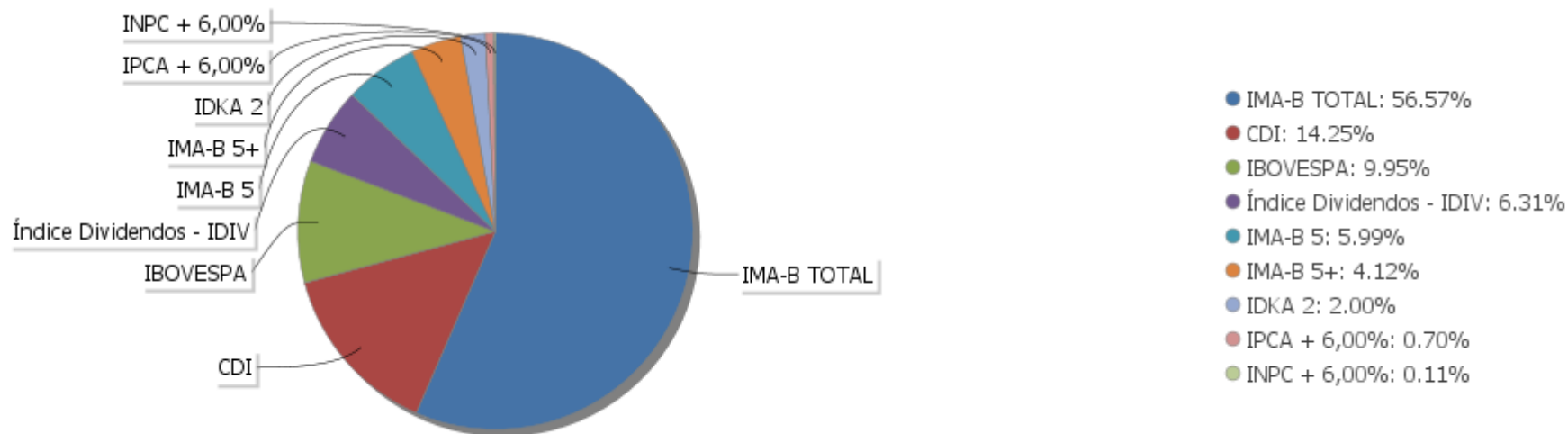
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	262.743.045,54	82,69	262.743.045,54	82,69
de 31 a 365 dias	13.138.909,13	4,14	275.881.954,67	86,83
acima de 365 dias	41.859.996,95	13,17	317.741.951,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

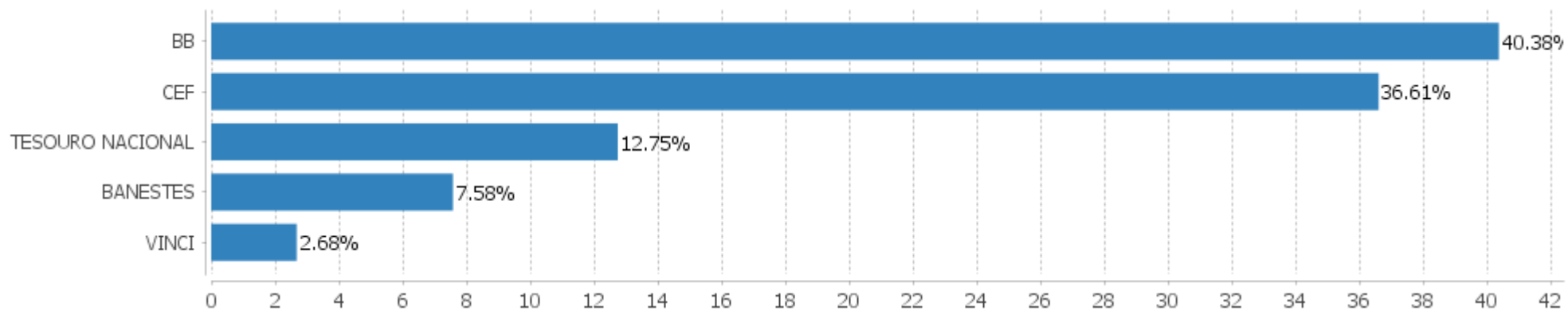


Alocação Por Estratégia



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	3,52	5,16	4,37
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	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,85	-1,86	-11,35	2,48	1,98	2,24	4,21	-2,85	-3,17	-1,07	2,17	3,31	-6,25
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 + 6,00%	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

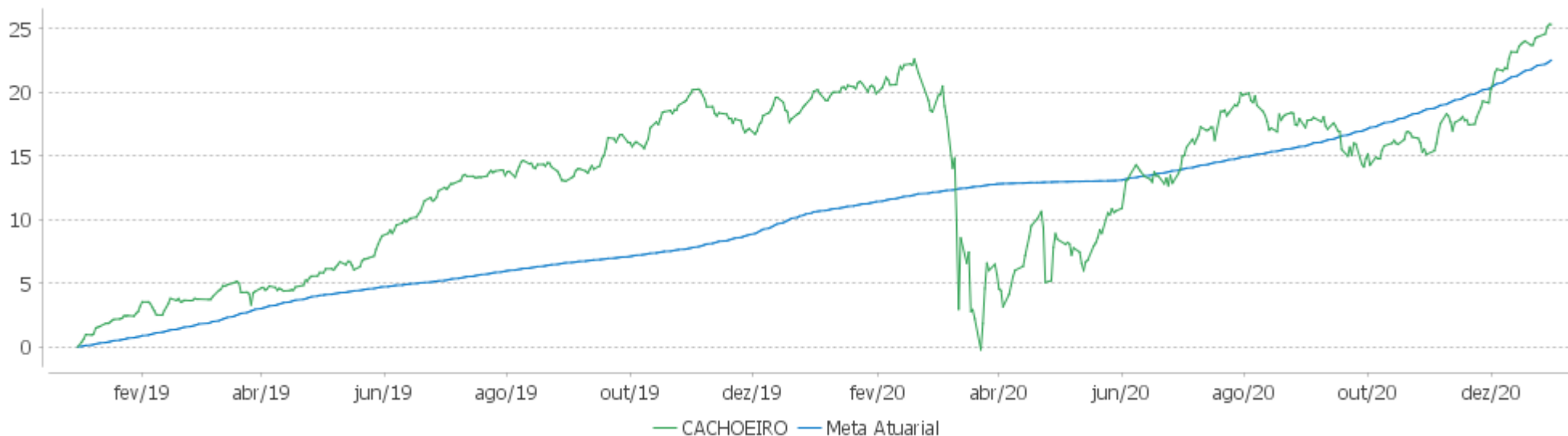
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

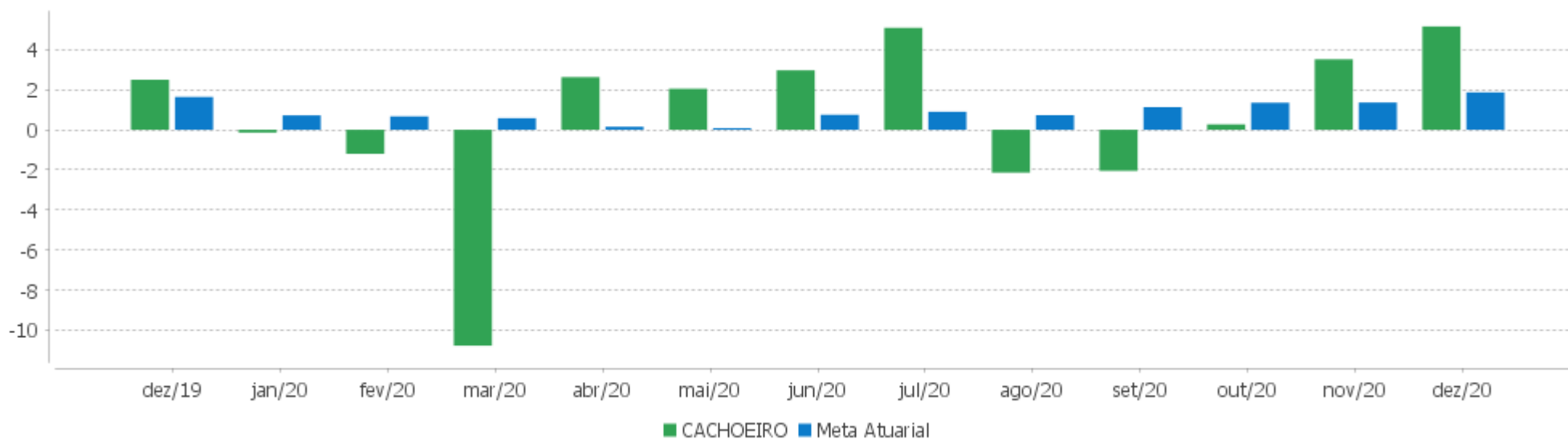
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	58,33	03 meses	9,16	4,61	4,55	5,55
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	41,67	06 meses	9,96	7,48	2,48	7,22
			12 meses	4,37	10,62	-6,25	15,16
			24 meses	25,30	22,33	2,97	11,06
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,16	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-10,78	2020-03	Desde 31/12/2018	25,30	22,33	2,97	11,06

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.	7,94 3,09	-0,03 -6,44	10,87 3,70	9,15 0,95	-0,03 -6,44	30,99 0,17	48,59 0,68
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21 -3,65	5,61 -0,79	2,89 -4,28	3,91 -4,30	5,61 -0,79	16,66 -14,17	28,09 -19,82
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,53 -0,21	7,92 -0,70	3,22 0,18	4,89 -0,21	7,92 -0,70	20,01 -1,46	31,07 -2,24
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	7,78 -0,26	3,34 -0,05	4,56 -0,16	7,78 -0,26	21,67 -0,58	33,42 -0,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,65 -0,08	8,03 -0,59	3,05 0,00	4,76 -0,34	8,03 -0,59	20,12 -1,34	31,29 -2,02
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	1,61 -0,36	6,92 -4,83	3,22 -1,63	4,30 -3,93	6,92 -4,83	20,48 -3,31	42,15 6,49
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,56 0,05	5,23 -0,26	10,56 0,03	11,28 -0,08	5,23 -0,26	36,52 -1,01	56,97 -1,75
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	7,47 -0,04	5,06 -0,44	10,38 -0,15	11,03 -0,33	5,06 -0,44	36,63 -0,90	57,32 -1,41
NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p.	9,23 4,38	2,58 -3,82	13,14 5,96	13,64 5,43	2,58 -3,82	36,23 5,40	52,67 4,76
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,32 197,00	0,21 7,48	0,61 128,41	1,78 180,13	0,21 7,48	6,30 70,95	13,70 86,29
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,25 153,00	2,40 87,00	0,57 120,84	1,01 102,85	2,40 87,00	8,28 93,21	15,14 95,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,36 220,55	2,42 87,59	0,64 135,47	1,03 104,71	2,42 87,59	8,27 93,10	15,01 94,59
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,85 0,00	6,05 -0,36	7,10 -0,07	8,06 -0,15	6,05 -0,36	29,87 -0,95	46,68 -1,23
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	1,78	7,59	2,87	3,90	7,59	25,32	35,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,09	-3,18	-1,77	-3,65	-3,18	2,83	0,37
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,30 -2,17	-7,06 -17,82	3,60 -1,04	2,00 -5,55	-7,06 -17,82	-69,71 -92,20	-70,17 -104,81
BB ACOES ALO ETF % do CDI	8,43 5.125,90	1,82 66,13	24,03 5.093,84	24,56 2.490,92	1,82 66,13	36,42 410,07	57,65 363,16
CXCE11B Var. IBOVESPA p.p.	-2,55 -11,84	-0,48 -3,40	5,25 -20,56	8,36 -16,85	-0,48 -3,40	28,79 -6,63	35,87 -19,91
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,18 -3,76	7,76 8,76	12,31 -13,13	17,59 -3,70	7,76 8,76	49,95 6,24	81,31 14,67
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	7,60 -1,70	-3,23 -6,15	21,53 -4,28	23,20 -2,01	-3,23 -6,15	49,75 14,33	57,25 1,48
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,64 -2,30	-0,62 0,38	23,88 -1,56	26,47 5,18	-0,62 0,38	50,58 6,87	50,60 -16,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	9,37 0,43	3,05 4,05	25,03 -0,40	23,84 2,55	3,05 4,05	46,40 2,69	65,37 -1,26
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	9,09 -0,21	4,61 1,70	24,13 -1,68	24,17 -1,04	4,61 1,70	34,90 -0,52	55,92 0,14
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	9,08 -0,21	2,57 -0,35	25,22 -0,59	24,65 -0,56	2,57 -0,35	33,93 -1,49	53,25 -2,52
CACHOEIRO Var. IPCA + 6,00% p.p.	5,16 3,29	4,37 -6,39	9,16 4,51	9,96 2,41	4,37 -6,39	25,30 2,81	
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

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	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

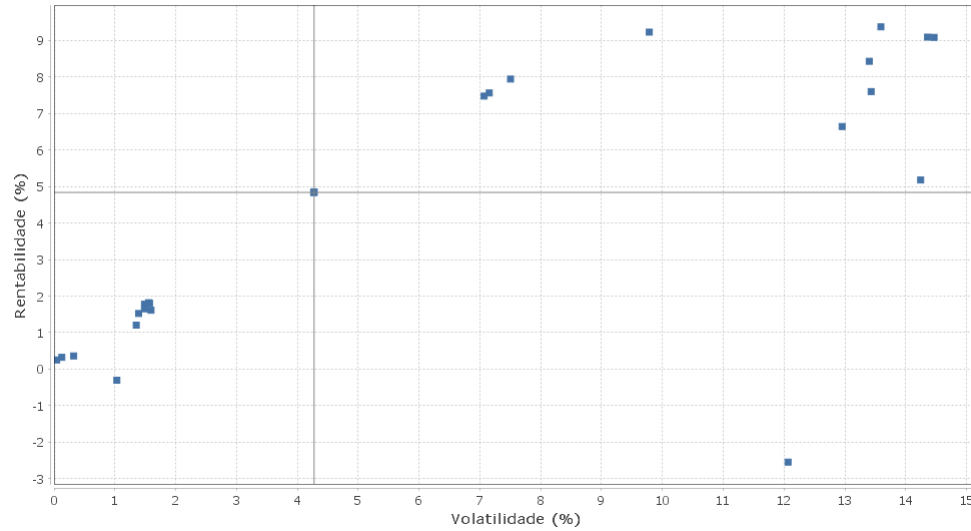
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
175	01/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	375.000,00	163.307,07426900	2,2962875410
176	01/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.064,56594100	2,2962875410
177	01/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.830.595,76	0,00	797.197,96729000	2,2962875410
178	01/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.821,51	0,00	30.812,98572300	3,7264000000
179	04/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	68.000,00	0,00	18.240,50481100	3,7279670000
180	07/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.000,00	0,00	3.482,07399100	2,2974813340
181	07/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.057,77747000	2,2974813340
182	07/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.500,00	1.088,14812200	2,2974813340
183	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	68.000,00	0,00	18.219,10401600	3,7323460000
184	14/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	61.000,00	26.536,06167000	2,2987586010
185	14/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.114,28	0,00	9.620,09668600	2,2987586010
186	16/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.250.000,00	1.413.496,93852600	2,2992621430
187	16/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.000,00	43.492,21349300	2,2992621430
188	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	46.000,00	0,00	12.313,58635600	3,7357110000
189	21/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	135.000,00	0,00	58.695,44480000	2,3000081260
190	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	172.232,27	0,00	46.098,51832500	3,7361780000
191	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	67.000,00	0,00	17.926,57488900	3,7374680000
192	28/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.193.000,00	0,00	953.033,23578400	2,3010740000
193	28/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.420,57752200	2,3010740000
194	28/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.794.474,63	0,00	1.214.421,88734400	2,3010740000
195	29/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	140.000,00	60.833,92656100	2,3013474210
196	29/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	13.035,84140600	2,3013474210
197	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	60.000,00	16.048,41911100	3,7386860000
198	30/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.435.000,00	0,00	1.057.964,89098400	2,3015886640
199	30/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	8.689,65002900	2,3015886640

Total

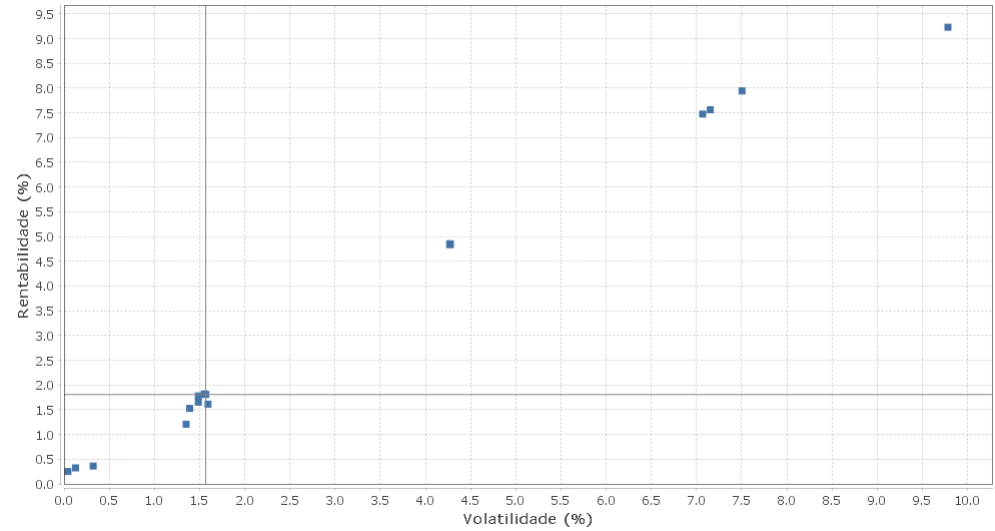
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

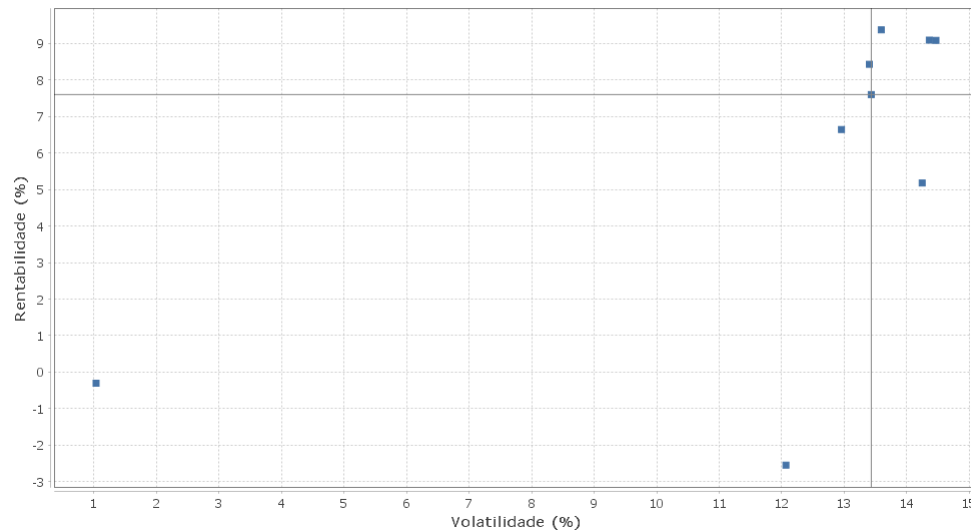
CACHOEIRO - No Mês



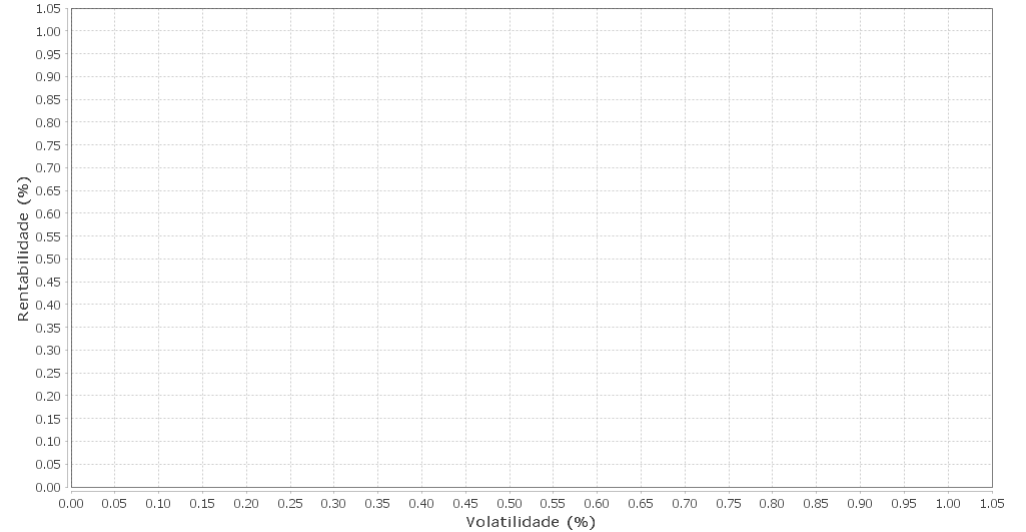
Renda Fixa - No Mês



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\$): 10.395.003,63

Value-At-Risk: 3,27%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,09	0,00	2,04	0,25	29.823.632,42	9,39
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,09	-0,00	1,25	0,32	1.662.570,38	0,52
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,32	0,13	0,00	0,61	0,36	11.319.888,24	3,56
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,03	0,12	0,00	-0,45	-0,30	353.751,02	0,11
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	1,11	0,00	0,77	1,21	989.926,05	0,31
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,39	0,94	0,01	0,98	1,53	3.648.074,06	1,15
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	1,49	1,75	0,01	1,09	1,78	1.874.882,00	0,59
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,01	1,00	1,65	2.699.154,97	0,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,02	1,07	1,82	7.500.050,72	2,36
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,57	1,05	0,03	1,05	1,81	11.529.661,63	3,63
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,59	1,11	0,00	0,91	1,61	355.032,06	0,11
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,40	1,09	4,84	53.605.578,88	16,87
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,27	2,56	0,12	1,10	4,85	15.747.899,49	4,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,38	1,09	4,84	51.079.411,61	16,08
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,07	4,56	0,08	1,03	7,47	6.265.108,28	1,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,15	4,57	0,09	1,03	7,56	6.833.886,30	2,15
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	7,50	4,72	0,03	1,04	7,94	17.804.375,45	5,60
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	9,78	6,73	0,77	0,93	9,23	40.515.038,84	12,75
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	12,07	3,34	-0,01	-0,22	-2,55	5.211.000,00	1,64
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	12,95	10,75	0,19	0,50	6,64	6.902.190,33	2,17
BB ACOES ALO ETF	Artigo 8º II, Alínea b	13,40	9,85	0,06	0,62	8,43	2.475.552,98	0,78
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	13,43	10,55	0,20	0,55	7,60	7.338.158,79	2,31
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,59	9,81	0,22	0,68	9,37	8.526.194,36	2,68
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	14,25	10,20	0,11	0,35	5,18	4.612.714,77	1,45
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	14,36	10,45	0,35	0,62	9,09	12.697.401,70	4,00
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	14,47	11,36	0,19	0,62	9,08	6.370.816,29	2,01